

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／債券／インデックス型	
信託期間	無期限（2015年8月27日設定）	
運用方針	日本債券インデックスマザーファンド受益証券およびヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券等への投資を通じて、主として日本を含む先進国の公社債に実質的な投資を行い、NOMURA-BPI総合およびFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）を50%ずつ組み合わせ合わせた合成ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。国内債券および先進国債券への実質的な基本投資割合は、純資産総額に対してそれぞれ50%とします。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し公社債の実質投資比率が100%を超える場合があります。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減をはかります。	
主要運用対象	ベビーファンド	日本債券インデックスマザーファンド受益証券およびヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、日本を含む先進国の公社債に直接投資することがあります。
	日本債券インデックスマザーファンド	NOMURA-BPI総合に採用されている公社債を主要投資対象とします。
	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーファンド	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	日本債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	
	分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。）	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。
 ※公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。
 詳しくは販売会社にお問い合わせください。

運用報告書（全体版）

eMAXIS
 イーマックス

eMAXIS 債券バランス （2資産均等型）

第7期（決算日：2022年1月26日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。
 さて、お手持ちの「eMAXIS 債券バランス（2資産均等型）」は、去る1月26日に第7期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。
 今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

MUFG

三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
 ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客様専用
 フリーダイヤル **0120-151034**
 （受付時間：営業日の9:00～17:00、
 土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）

お客さまのお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.jp/>

本資料の表記にあたって

- ・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
- ・一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

○最近5期の運用実績

決算期	基準 (分配落)	価 額			合 成 ベ ン チ マ ー ク		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 総 額
		税 込 分 配	み 金	期 騰 落	中 率	期 騰 落			
	円	円	円	%		%	%	%	百万円
3期(2018年1月26日)	10,188		0	0.4	10,309	0.8	98.5	0.1	153
4期(2019年1月28日)	10,246		0	0.6	10,417	1.1	98.3	0.1	259
5期(2020年1月27日)	10,601		0	3.5	10,827	3.9	97.5	0.0	199
6期(2021年1月26日)	10,706		0	1.0	10,997	1.6	98.6	0.0	188
7期(2022年1月26日)	10,427		0	△2.6	10,764	△2.1	97.9	0.1	188

(注) 当ファンドのベンチマークは、NOMURA-BPI総合およびFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）を50%ずつ組み合わせた合成指数です。ベンチマークは、設定日の前営業日の値を10,000として委託会社が計算したものです。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		合 成 ベ ン チ マ ー ク		債 券 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	円	騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2021年1月26日	10,706	% —	10,997	% —	% 98.6	% 0.0
1月末	10,693	△0.1	10,985	△0.1	98.8	0.1
2月末	10,486	△2.1	10,774	△2.0	99.5	0.1
3月末	10,508	△1.8	10,803	△1.8	99.7	0.1
4月末	10,509	△1.8	10,809	△1.7	98.4	0.1
5月末	10,519	△1.7	10,820	△1.6	98.8	0.2
6月末	10,537	△1.6	10,847	△1.4	98.3	0.2
7月末	10,652	△0.5	10,968	△0.3	98.1	0.2
8月末	10,644	△0.6	10,965	△0.3	98.5	0.2
9月末	10,538	△1.6	10,860	△1.2	98.9	0.2
10月末	10,526	△1.7	10,851	△1.3	99.6	0.2
11月末	10,567	△1.3	10,899	△0.9	97.6	0.1
12月末	10,504	△1.9	10,838	△1.4	100.0	0.1
(期 末) 2022年1月26日	10,427	△2.6	10,764	△2.1	97.9	0.1

(注) 騰落率は期首比。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

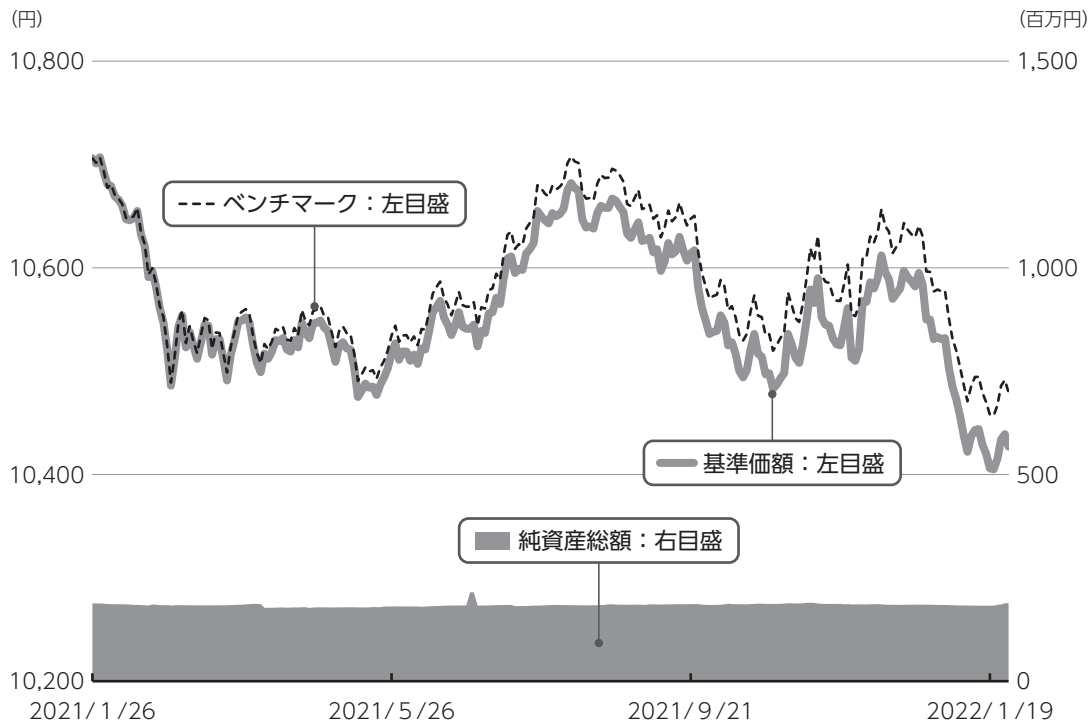
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第7期：2021年1月27日～2022年1月26日

▶ 当期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第7期首	10,706円
第7期末	10,427円
既払分配金	0円
騰落率	-2.6%

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

※実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみなさまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

基準価額の動き

基準価額は期首に比べ2.6%の下落となりました。

ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（-2.1%）を0.5%下回りました。

基準価額の主な変動要因**下落要因**

主に外国債券市況が下落したことなどが、基準価額の下落要因となりました。

組入ファンド	騰落率	組入比率（対純資産総額）
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	-4.0%	50.1%
日本債券インデックスマザーファンド	-0.4%	49.4%

第7期：2021年1月27日～2022年1月26日

投資環境について

▶ 国内債券市況

国内債券市況は下落しました。

国内債券市況は、期の初めに日銀の金融政策点検に対する警戒感などから下落しましたが、公表された点検結果は概ね市場予想通りとなり、長期金利の許容変動幅が明確化された安心感から国内債券市況は反発しました。その後、新型コロナウイルス感染再拡大による景気回復の後ずれ懸念などから国内債券市況は上昇しましたが、期の終わりにかけて米国の利上げ前倒し観測の高まりなどから反落し

ました。期を通して見ると国内債券市況は下落しました。

▶ 外国債券市況

先進国の債券市況は下落しました。

先進国の債券市況は、期中頃には新型コロナウイルス感染再拡大による景気の先行き懸念を背景とした金利低下等により、上昇する局面もありましたが、経済正常化期待や利上げ観測を背景とした金利上昇等により、期首との比較では下落しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

▶ eMAXIS 債券バランス（2資産均等型）

日本を含む先進国の債券市場の値動きに連動する投資成果をめざして国内債券、日本を除く先進国債券の指数を均等比率で組み合わせた合成ベンチマークに連動するよう運用を行いました。

当期の資産配分は、国内債券およびヘッジ付先進国債券への実質的な基本投資割合は、純資産総額に対してそれぞれ50%となるように調整を行いました。

▶ 日本債券インデックスマザーファンド

資産のほぼ全額を債券（先物を含む）に投資し、高い公社債組入比率を維持しま

した。

ベンチマーク（NOMURA-BPI総合）の構成銘柄を種別や年限等の属性でグループに区切り、ベンチマークの各グループの比率とポートフォリオの同じグループの比率を極力近づけるように、ポートフォリオを構築しました*。

※一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

▶ ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、円

ヘッジ・円ベース) に連動する投資成果をめざして運用を行いました。
ベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポート

フォリオを構築しました。
組入外貨建資産については、ベンチマークとの連動を維持するため、為替ヘッジを行いました。

▶ 当該投資信託のベンチマークとの差異について

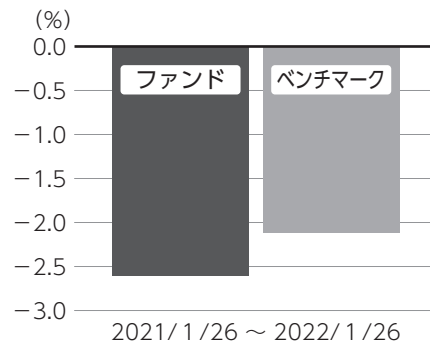
▶ eMAXIS 債券バランス（2資産均等型）

基準価額の騰落率は2.6%の下落となり、ベンチマークの2.1%の下落を0.5%下回りました。
差異の内訳は以下の通りです。

(内訳)

日本債券インデックスマザーファンド	0.0%程度
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	0.0%程度
その他（信託報酬等）	△0.5%程度

基準価額（ベビーファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



▶ 日本債券インデックスマザーファンド

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：取引要因によるものです。

主なマイナス要因：評価時価差異要因*によるものです。

*ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる債券時価が異なるため生じる要因です。

▶ ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：ありません。

主なマイナス要因：評価時価差異要因*によるものです。

*ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる債券時価や為替レートが異なるため生じる要因です。

分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項目	第7期
	2021年1月27日～2022年1月26日
当期分配金（対基準価額比率）	－（－％）
当期の収益	－
当期の収益以外	－
翌期繰越分配対象額	791

(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

今後の運用方針 （作成対象期間末での見解です。）

▶ eMAXIS 債券バランス（2資産均等型）

資産配分方針は、従前通り基本投資割合を維持します。また、各資産の組入比率は、期を通じて同比率に準ずるよう調整を行います。

▶ 日本債券インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

▶ ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

組入外貨建資産については、原則としてベンチマークとの連動を維持するため、為替ヘッジを行います。

2021年1月27日～2022年1月26日

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	46	0.440	(a) 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (期中の日数 ÷ 年間日数)
(投 信 会 社)	(20)	(0.192)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(20)	(0.192)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(6)	(0.055)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	0	0.000	(b) 売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 ÷ 期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	1	0.009	(c) その他費用 = 期中のその他費用 ÷ 期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(1)	(0.005)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
(監 査 費 用)	(0)	(0.004)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	47	0.449	

期中の平均基準価額は、10,557円です。

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

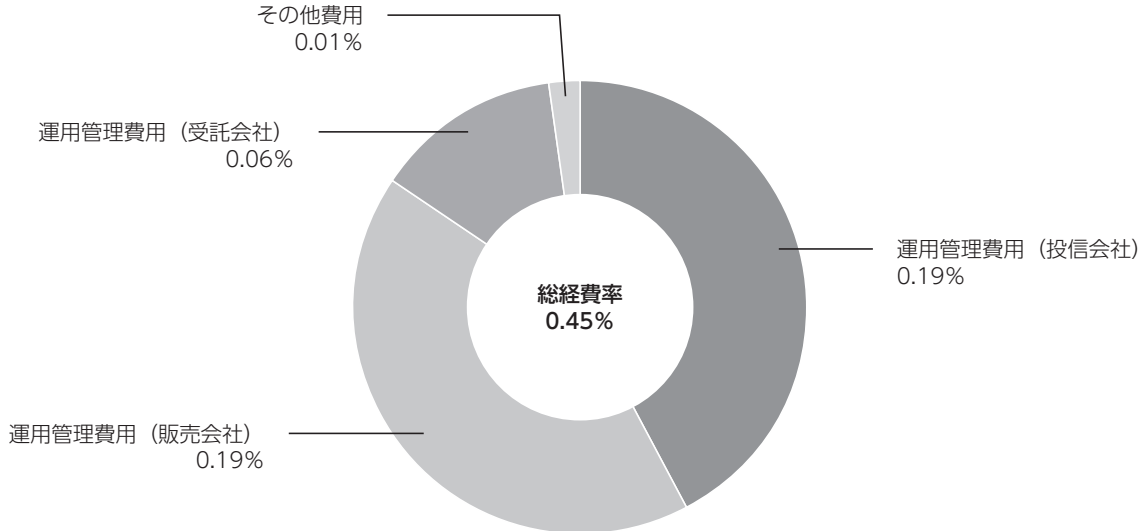
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

（参考情報）

■ 総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.45%**です。



(注) 費用は、1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 前記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2021年1月27日～2022年1月26日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	27,679	37,868	24,754	33,945
日本債券インデックスマザーファンド	25,838	34,786	25,436	34,220

○利害関係人との取引状況等

(2021年1月27日～2022年1月26日)

利害関係人との取引状況

< eMAXIS 債券バランス（2資産均等型） >

該当事項はございません。

<ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド>

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	%	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	%
為替先物取引	百万円 3,287,619	百万円 698,575	21.2	百万円 3,297,418	百万円 729,300	22.1
為替直物取引	66,133	54,221	82.0	46,398	21,623	46.6

平均保有割合 0.0%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

<日本債券インデックスマザーファンド>

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	%	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	%
公社債	百万円 500,294	百万円 57,516	11.5	百万円 152,376	百万円 31,354	20.6

平均保有割合 0.0%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

利害関係人の発行する有価証券等

<日本債券インデックスマザーファンド>

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
公社債	百万円 2,822	百万円 705	百万円 3,958

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

<日本債券インデックスマザーファンド>

種 類	買 付 額
公社債	百万円 9,099

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、三菱UFJモルガン・スタンレー証券、三菱UFJフィナンシャル・グループ、三菱HCキャピタル、アコム、モルガン・スタンレーMUF G証券です。

○組入資産の明細

(2022年1月26日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	66,972	69,897	94,361
日本債券インデックスマザーファンド	69,064	69,466	93,169

○投資信託財産の構成

(2022年1月26日現在)

項 目	当 期 末	比 率
	評 価 額	
	千円	%
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	94,361	50.0
日本債券インデックスマザーファンド	93,169	49.3
コール・ローン等、その他	1,355	0.7
投資信託財産総額	188,885	100.0

(注) ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（275,215,180千円）の投資信託財産総額（281,044,741千円）に対する比率は97.9%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 アメリカドル=113.84円	1 カナダドル=90.14円	1 メキシコペソ=5.5221円	1 ユーロ=128.65円
1 イギリスポンド=153.82円	1 スウェーデンクローネ=12.30円	1 ノルウェークローネ=12.76円	1 デンマーククローネ=17.29円
1 ポーランドズロチ=28.0868円	1 オーストラリアドル=81.45円	1 シンガポールドル=84.71円	1 マレーシアリングギット=27.163円
1 中国元=17.9929円	1 イスラエルシェケル=35.8499円		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2022年1月26日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	188,885,049
コール・ローン等	1,354,883
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	94,361,070
日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	93,169,096
(B) 負債	415,180
未払解約金	115
未払信託報酬	411,409
その他未払費用	3,656
(C) 純資産総額(A-B)	188,469,869
元本	180,749,538
次期繰越損益金	7,720,331
(D) 受益権総口数	180,749,538口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,427円

<注記事項>

- ①期首元本額 175,652,658円
 期中追加設定元本額 80,185,251円
 期中一部解約元本額 75,088,371円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0427円です。

②分配金の計算過程

項 目	2021年1月27日～ 2022年1月26日
費用控除後の配当等収益額	1,713,930円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	-円
収益調整金額	10,740,594円
分配準備積立金額	1,846,820円
当ファンドの分配対象収益額	14,301,344円
1万口当たり収益分配対象額	791円
1万口当たり分配金額	-円
収益分配金金額	-円

*三菱UFJ国際投信では本資料のほかに当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ（<https://www.am.mufg.jp/>）をご覧ください。

【お知らせ】

「FTSE世界国債インデックス」について、2021年10月末より中国国債の組み入れに伴い、当該指数を参照等する当ファンドにおいて、新たに中国国債の組み入れを適宜開始します。

○損益の状況（2021年1月27日～2022年1月26日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 105
受取利息	2
支払利息	△ 107
(B) 有価証券売買損益	△ 3,169,056
売買益	668,995
売買損	△ 3,838,051
(C) 信託報酬等	△ 817,551
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 3,986,712
(E) 前期繰越損益金	681,256
(F) 追加信託差損益金	11,025,787
(配当等相当額)	(10,692,452)
(売買損益相当額)	(333,335)
(G) 計(D+E+F)	7,720,331
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	7,720,331
追加信託差損益金	11,025,787
(配当等相当額)	(10,740,594)
(売買損益相当額)	(285,193)
分配準備積立金	3,560,750
繰越損益金	△ 6,866,206

- (注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
 (注) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
 (注) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

日本債券インデックスマザーファンド

《第20期》決算日2021年5月12日

[計算期間：2020年5月13日～2021年5月12日]

「日本債券インデックスマザーファンド」は、5月12日に第20期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第20期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	NOMURA-BPI総合と連動する投資成果をめざして運用を行います。投資成果をNOMURA-BPI総合の動きにできるだけ連動させるため、公社債の実質投資比率（組入現物公社債の時価総額に債券先物取引等の買建額を加算し、または債券先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。
主要運用対象	NOMURA-BPI総合に採用されている公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資は行いません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		NOMURA-BPI総合		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	円	騰落率		騰落率			
16期(2017年5月12日)	13,180	△2.2%	378.85	△2.2%	99.3%	0.2%	457,117
17期(2018年5月14日)	13,283	0.8%	381.82	0.8%	98.4%	0.3%	544,273
18期(2019年5月13日)	13,503	1.7%	388.16	1.7%	99.8%	0.1%	608,830
19期(2020年5月12日)	13,524	0.2%	388.75	0.2%	99.6%	0.1%	630,705
20期(2021年5月12日)	13,462	△0.5%	386.93	△0.5%	99.5%	0.2%	314,171

(注) NOMURA-BPI総合とは、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基準 価 額		N O M U R A - B P I 総合		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	率	騰 落 率	率		
(期 首) 2020年5月12日	円 13,524	% —	388.75	% —	% 99.6	% 0.1
5月末	13,500	△0.2	388.13	△0.2	99.5	0.1
6月末	13,447	△0.6	386.56	△0.6	99.7	0.1
7月末	13,494	△0.2	387.91	△0.2	99.6	0.1
8月末	13,432	△0.7	386.09	△0.7	98.9	0.1
9月末	13,471	△0.4	387.22	△0.4	99.7	0.2
10月末	13,450	△0.5	386.63	△0.5	99.6	0.1
11月末	13,468	△0.4	387.12	△0.4	99.5	0.1
12月末	13,470	△0.4	387.20	△0.4	99.6	0.2
2021年1月末	13,437	△0.6	386.25	△0.6	99.6	0.1
2月末	13,326	△1.5	383.06	△1.5	99.4	0.3
3月末	13,419	△0.8	385.72	△0.8	99.5	0.3
4月末	13,444	△0.6	386.44	△0.6	99.1	0.3
(期 末) 2021年5月12日	13,462	△0.5	386.93	△0.5	99.5	0.2

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.5%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(−0.5%)とほぼ同程度となりました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

● 基準価額の主な変動要因

(下落要因)

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

● 投資環境について**◎ 国内債券市況**

- ・国内債券市況は下落しました。
- ・国内債券市況は、期の前半はやや下落したあと概ね横ばいで推移しましたが、期の後半にインフレや米債増発への懸念による米金利の上昇、日本銀行の金融政策点検に対する警戒感などから下落しました。公表された点検結果は概ね市場予想通りとなり、長期金利の許容変動幅が明確化された安心感から、国内債券市況は反発したものの、期を通してみると国内債券市況は下落しました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

- ・資産のほぼ全額を債券(先物を含む)に投資し、高い公社債組入比率を維持しました。
- ・ベンチマーク(NOMURA-BPI総合)の構成銘柄を種別や年限等の属性でグループに区切り、ベンチマークの各グループの比率とポートフォリオの同じグループの比率を極力近づけるように、ポートフォリオを構築しました*。
※一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは0.5%の下落になったため、乖離は0.0%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・取引要因によるものです。

(主なマイナス要因)

- ・ポートフォリオ要因によるものです。

○ 今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1万口当たりの費用明細

(2020年5月13日～2021年5月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、13,455円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○ 売買及び取引の状況

(2020年5月13日～2021年5月12日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国債証券	155,268,219	415,803,696
	地方債証券	6,996,873	22,992,622 (36,650)
	特殊債券	7,504,707	27,814,826 (529,101)
	社債券	23,993,981	35,628,990 (200,000)

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	債券先物取引	百万円 10,000	百万円 9,856	百万円 -	百万円 -

○利害関係人との取引状況等

(2020年5月13日～2021年5月12日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$ %
公社債	百万円 193,763	百万円 52,248	27.0	百万円 502,240	百万円 73,722	14.7

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
公社債	百万円 1,622	百万円 3,733	百万円 2,146

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
公社債	百万円 13,200

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、三菱UFJモルガン・スタンレー証券、三菱UFJフィナンシャル・グループ、三菱HCキャピタル、アコムです。

○組入資産の明細

(2021年5月12日現在)

国内公社債

(A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率			
					5年以上	2年以上	2年未満	
	千円	千円	%	%	%	%	%	
国債証券	242,655,000	259,888,132	82.7	—	56.6	18.1	8.0	
地方債証券	14,919,160	15,856,280	5.0	—	2.2	1.8	1.0	
	(14,919,160)	(15,856,280)	(5.0)	(—)	(2.2)	(1.8)	(1.0)	
特殊債券 (除く金融債)	16,937,895	17,942,101	5.7	—	3.1	1.3	1.3	
	(16,937,895)	(17,942,101)	(5.7)	(—)	(3.1)	(1.3)	(1.3)	
金融債券	1,500,000	1,508,993	0.5	—	—	0.3	0.2	
	(1,500,000)	(1,508,993)	(0.5)	(—)	(—)	(0.3)	(0.2)	
普通社債券	17,350,000	17,533,409	5.6	0.0	1.7	3.4	0.5	
	(17,350,000)	(17,533,409)	(5.6)	(0.0)	(1.7)	(3.4)	(0.5)	
合 計	293,362,055	312,728,916	99.5	0.0	63.7	24.9	11.0	
	(50,707,055)	(52,840,783)	(16.8)	(0.0)	(7.0)	(6.8)	(3.0)	

(注) ()内は非上場債で内書き。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(注) 現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

(B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	当期末		
	利率	額面金額	評価額
	%	千円	千円
国債証券			
第413回利付国債(2年)	0.1	1,160,000	1,162,807
第415回利付国債(2年)	0.1	1,050,000	1,053,076
第418回利付国債(2年)	0.1	1,760,000	1,766,212
第420回利付国債(2年)	0.1	430,000	431,655
第421回利付国債(2年)	0.1	150,000	150,607
第422回利付国債(2年)	0.1	1,100,000	1,104,763
第423回利付国債(2年)	0.005	1,700,000	1,704,488
第132回利付国債(5年)	0.1	1,950,000	1,954,836
第133回利付国債(5年)	0.1	2,300,000	2,307,015
第134回利付国債(5年)	0.1	3,740,000	3,753,838
第136回利付国債(5年)	0.1	1,810,000	1,818,959
第137回利付国債(5年)	0.1	1,660,000	1,669,412
第138回利付国債(5年)	0.1	3,600,000	3,623,040
第139回利付国債(5年)	0.1	600,000	604,206
第140回利付国債(5年)	0.1	1,510,000	1,521,294
第141回利付国債(5年)	0.1	1,770,000	1,784,018
第142回利付国債(5年)	0.1	1,150,000	1,159,579
第143回利付国債(5年)	0.1	1,460,000	1,472,994
第144回利付国債(5年)	0.1	3,990,000	4,027,027
第145回利付国債(5年)	0.1	2,580,000	2,604,845
第146回利付国債(5年)	0.1	1,640,000	1,655,547
第147回利付国債(5年)	0.005	320,000	321,558
第1回利付国債(40年)	2.4	225,000	326,976
第2回利付国債(40年)	2.2	470,000	662,902
第3回利付国債(40年)	2.2	433,000	613,192
第4回利付国債(40年)	2.2	578,000	822,546
第5回利付国債(40年)	2.0	605,000	834,186
第6回利付国債(40年)	1.9	570,000	774,362
第7回利付国債(40年)	1.7	610,000	798,520
第8回利付国債(40年)	1.4	630,000	771,806
第9回利付国債(40年)	0.4	1,100,000	1,011,791
第10回利付国債(40年)	0.9	1,110,000	1,195,891
第11回利付国債(40年)	0.8	890,000	931,073
第12回利付国債(40年)	0.5	860,000	813,396
第13回利付国債(40年)	0.5	1,140,000	1,076,935
第323回利付国債(10年)	0.9	975,000	986,046
第324回利付国債(10年)	0.8	1,200,000	1,212,264
第325回利付国債(10年)	0.8	2,335,000	2,364,327
第326回利付国債(10年)	0.7	530,000	537,033
第327回利付国債(10年)	0.8	1,340,000	1,359,939
第328回利付国債(10年)	0.6	1,800,000	1,824,390
第329回利付国債(10年)	0.8	3,160,000	3,222,315
第330回利付国債(10年)	0.8	1,730,000	1,768,440
第331回利付国債(10年)	0.6	760,000	773,292

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第332回利付国債 (10年)	0.6	1,240,000	1,263,994	2023/12/20
第333回利付国債 (10年)	0.6	3,250,000	3,319,322	2024/3/20
第334回利付国債 (10年)	0.6	2,830,000	2,895,288	2024/6/20
第335回利付国債 (10年)	0.5	2,370,000	2,420,718	2024/9/20
第336回利付国債 (10年)	0.5	2,280,000	2,332,029	2024/12/20
第337回利付国債 (10年)	0.3	640,000	649,964	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)	0.4	1,980,000	2,020,609	2025/3/20
第339回利付国債 (10年)	0.4	1,860,000	1,900,269	2025/6/20
第340回利付国債 (10年)	0.4	1,050,000	1,073,908	2025/9/20
第341回利付国債 (10年)	0.3	1,870,000	1,905,473	2025/12/20
第342回利付国債 (10年)	0.1	1,690,000	1,706,477	2026/3/20
第343回利付国債 (10年)	0.1	2,120,000	2,140,648	2026/6/20
第344回利付国債 (10年)	0.1	2,480,000	2,504,676	2026/9/20
第345回利付国債 (10年)	0.1	2,730,000	2,757,654	2026/12/20
第346回利付国債 (10年)	0.1	2,440,000	2,465,083	2027/3/20
第347回利付国債 (10年)	0.1	2,050,000	2,071,361	2027/6/20
第348回利付国債 (10年)	0.1	3,360,000	3,395,380	2027/9/20
第349回利付国債 (10年)	0.1	2,260,000	2,283,978	2027/12/20
第350回利付国債 (10年)	0.1	2,470,000	2,495,465	2028/3/20
第351回利付国債 (10年)	0.1	1,560,000	1,575,553	2028/6/20
第352回利付国債 (10年)	0.1	1,380,000	1,393,220	2028/9/20
第353回利付国債 (10年)	0.1	2,740,000	2,765,043	2028/12/20
第354回利付国債 (10年)	0.1	2,050,000	2,067,712	2029/3/20
第355回利付国債 (10年)	0.1	2,490,000	2,510,169	2029/6/20
第356回利付国債 (10年)	0.1	3,000,000	3,022,530	2029/9/20
第357回利付国債 (10年)	0.1	1,410,000	1,419,686	2029/12/20
第358回利付国債 (10年)	0.1	2,670,000	2,686,500	2030/3/20
第359回利付国債 (10年)	0.1	3,740,000	3,760,345	2030/6/20
第360回利付国債 (10年)	0.1	2,850,000	2,863,252	2030/9/20
第361回利付国債 (10年)	0.1	2,380,000	2,387,949	2030/12/20
第362回利付国債 (10年)	0.1	660,000	661,610	2031/3/20
第1回利付国債 (30年)	2.8	76,000	93,625	2029/9/20
第2回利付国債 (30年)	2.4	98,000	118,379	2030/2/20
第3回利付国債 (30年)	2.3	117,000	140,825	2030/5/20
第4回利付国債 (30年)	2.9	127,000	161,305	2030/11/20
第5回利付国債 (30年)	2.2	58,000	70,255	2031/5/20
第6回利付国債 (30年)	2.4	169,000	209,587	2031/11/20
第7回利付国債 (30年)	2.3	114,000	141,179	2032/5/20
第8回利付国債 (30年)	1.8	142,000	168,934	2032/11/22
第9回利付国債 (30年)	1.4	116,000	132,766	2032/12/20
第10回利付国債 (30年)	1.1	135,000	149,933	2033/3/20
第11回利付国債 (30年)	1.7	137,000	162,243	2033/6/20
第12回利付国債 (30年)	2.1	120,000	148,297	2033/9/20
第13回利付国債 (30年)	2.0	205,000	251,450	2033/12/20
第14回利付国債 (30年)	2.4	303,000	387,982	2034/3/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第15回利付国債 (30年)	2.5	246,000	319,268	2034/6/20
第16回利付国債 (30年)	2.5	202,000	262,949	2034/9/20
第17回利付国債 (30年)	2.4	227,000	293,338	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)	2.3	327,000	419,272	2035/3/20
第19回利付国債 (30年)	2.3	303,000	389,479	2035/6/20
第20回利付国債 (30年)	2.5	395,000	520,329	2035/9/20
第21回利付国債 (30年)	2.3	279,000	360,607	2035/12/20
第22回利付国債 (30年)	2.5	410,000	543,270	2036/3/20
第23回利付国債 (30年)	2.5	54,000	71,735	2036/6/20
第24回利付国債 (30年)	2.5	311,000	414,174	2036/9/20
第25回利付国債 (30年)	2.3	442,000	576,792	2036/12/20
第26回利付国債 (30年)	2.4	584,000	773,093	2037/3/20
第27回利付国債 (30年)	2.5	60,000	80,769	2037/9/20
第28回利付国債 (30年)	2.5	611,000	826,621	2038/3/20
第29回利付国債 (30年)	2.4	50,000	67,100	2038/9/20
第30回利付国債 (30年)	2.3	796,000	1,059,468	2039/3/20
第31回利付国債 (30年)	2.2	858,000	1,130,801	2039/9/20
第32回利付国債 (30年)	2.3	739,000	991,220	2040/3/20
第33回利付国債 (30年)	2.0	694,000	896,703	2040/9/20
第34回利付国債 (30年)	2.2	896,000	1,195,918	2041/3/20
第35回利付国債 (30年)	2.0	1,119,000	1,457,385	2041/9/20
第36回利付国債 (30年)	2.0	959,000	1,253,115	2042/3/20
第37回利付国債 (30年)	1.9	1,117,000	1,442,393	2042/9/20
第38回利付国債 (30年)	1.8	625,000	796,831	2043/3/20
第39回利付国債 (30年)	1.9	710,000	921,601	2043/6/20
第40回利付国債 (30年)	1.8	640,000	817,990	2043/9/20
第41回利付国債 (30年)	1.7	450,000	566,577	2043/12/20
第42回利付国債 (30年)	1.7	660,000	831,811	2044/3/20
第43回利付国債 (30年)	1.7	760,000	958,816	2044/6/20
第44回利付国債 (30年)	1.7	620,000	782,967	2044/9/20
第45回利付国債 (30年)	1.5	640,000	780,896	2044/12/20
第46回利付国債 (30年)	1.5	900,000	1,098,819	2045/3/20
第47回利付国債 (30年)	1.6	800,000	995,720	2045/6/20
第48回利付国債 (30年)	1.4	770,000	924,477	2045/9/20
第49回利付国債 (30年)	1.4	930,000	1,117,050	2045/12/20
第50回利付国債 (30年)	0.8	880,000	934,225	2046/3/20
第51回利付国債 (30年)	0.3	840,000	792,800	2046/6/20
第52回利付国債 (30年)	0.5	860,000	850,428	2046/9/20
第53回利付国債 (30年)	0.6	790,000	798,863	2046/12/20
第54回利付国債 (30年)	0.8	630,000	667,157	2047/3/20
第55回利付国債 (30年)	0.8	790,000	836,033	2047/6/20
第56回利付国債 (30年)	0.8	820,000	867,182	2047/9/20
第57回利付国債 (30年)	0.8	770,000	813,728	2047/12/20
第58回利付国債 (30年)	0.8	1,280,000	1,351,705	2048/3/20
第59回利付国債 (30年)	0.7	630,000	649,227	2048/6/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
第60回利付国債 (30年)		0.9	730,000	787,940	2048/9/20
第61回利付国債 (30年)		0.7	690,000	708,857	2048/12/20
第62回利付国債 (30年)		0.5	610,000	594,731	2049/3/20
第63回利付国債 (30年)		0.4	600,000	568,404	2049/6/20
第64回利付国債 (30年)		0.4	900,000	850,194	2049/9/20
第65回利付国債 (30年)		0.4	650,000	613,021	2049/12/20
第66回利付国債 (30年)		0.4	280,000	263,631	2050/3/20
第67回利付国債 (30年)		0.6	1,290,000	1,280,479	2050/6/20
第68回利付国債 (30年)		0.6	790,000	783,150	2050/9/20
第69回利付国債 (30年)		0.7	940,000	956,412	2050/12/20
第70回利付国債 (30年)		0.7	100,000	101,631	2051/3/20
第56回利付国債 (20年)		2.0	349,000	357,198	2022/6/20
第58回利付国債 (20年)		1.9	147,000	151,042	2022/9/20
第59回利付国債 (20年)		1.7	489,000	503,352	2022/12/20
第61回利付国債 (20年)		1.0	289,000	295,060	2023/3/20
第63回利付国債 (20年)		1.8	342,000	355,926	2023/6/20
第64回利付国債 (20年)		1.9	341,000	357,402	2023/9/20
第65回利付国債 (20年)		1.9	218,000	229,597	2023/12/20
第66回利付国債 (20年)		1.8	70,000	73,541	2023/12/20
第68回利付国債 (20年)		2.2	646,000	689,185	2024/3/20
第70回利付国債 (20年)		2.4	222,000	239,542	2024/6/20
第71回利付国債 (20年)		2.2	160,000	171,644	2024/6/20
第72回利付国債 (20年)		2.1	434,000	466,701	2024/9/20
第73回利付国債 (20年)		2.0	320,000	344,688	2024/12/20
第74回利付国債 (20年)		2.1	318,000	343,688	2024/12/20
第75回利付国債 (20年)		2.1	475,000	515,907	2025/3/20
第76回利付国債 (20年)		1.9	200,000	215,676	2025/3/20
第77回利付国債 (20年)		2.0	110,000	119,047	2025/3/20
第78回利付国債 (20年)		1.9	310,000	335,826	2025/6/20
第79回利付国債 (20年)		2.0	50,000	54,371	2025/6/20
第80回利付国債 (20年)		2.1	215,000	234,685	2025/6/20
第81回利付国債 (20年)		2.0	250,000	273,147	2025/9/20
第82回利付国債 (20年)		2.1	462,000	506,800	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)		2.1	213,000	234,734	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)		2.0	470,000	515,782	2025/12/20
第85回利付国債 (20年)		2.1	290,000	321,027	2026/3/20
第86回利付国債 (20年)		2.3	515,000	575,121	2026/3/20
第87回利付国債 (20年)		2.2	250,000	277,967	2026/3/20
第88回利付国債 (20年)		2.3	804,000	902,530	2026/6/20
第89回利付国債 (20年)		2.2	210,000	234,658	2026/6/20
第90回利付国債 (20年)		2.2	800,000	898,352	2026/9/20
第91回利付国債 (20年)		2.3	468,000	528,053	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)		2.1	632,000	709,571	2026/12/20
第93回利付国債 (20年)		2.0	190,000	213,172	2027/3/20
第94回利付国債 (20年)		2.1	615,000	693,621	2027/3/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第95回利付国債 (20年)	2.3	617,000	706,637	2027/6/20
第96回利付国債 (20年)	2.1	220,000	249,264	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)	2.2	243,000	278,128	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)	2.1	270,000	307,308	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	845,000	966,037	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	660,000	762,102	2028/3/20
第101回利付国債 (20年)	2.4	373,000	435,831	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)	2.4	330,000	387,363	2028/6/20
第103回利付国債 (20年)	2.3	440,000	513,348	2028/6/20
第104回利付国債 (20年)	2.1	300,000	345,738	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)	2.1	570,000	659,507	2028/9/20
第106回利付国債 (20年)	2.2	361,000	420,348	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)	2.1	367,000	426,263	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)	1.9	500,000	573,120	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)	1.9	500,000	575,045	2029/3/20
第110回利付国債 (20年)	2.1	596,000	694,816	2029/3/20
第111回利付国債 (20年)	2.2	411,000	484,277	2029/6/20
第112回利付国債 (20年)	2.1	440,000	514,879	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)	2.1	562,000	660,063	2029/9/20
第114回利付国債 (20年)	2.1	1,020,000	1,202,253	2029/12/20
第115回利付国債 (20年)	2.2	654,000	776,474	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)	2.2	246,000	293,128	2030/3/20
第117回利付国債 (20年)	2.1	810,000	958,027	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)	2.0	76,000	89,552	2030/6/20
第119回利付国債 (20年)	1.8	160,000	185,627	2030/6/20
第120回利付国債 (20年)	1.6	260,000	296,925	2030/6/20
第121回利付国債 (20年)	1.9	609,000	714,247	2030/9/20
第122回利付国債 (20年)	1.8	100,000	116,351	2030/9/20
第123回利付国債 (20年)	2.1	518,000	618,916	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)	2.0	900,000	1,066,743	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)	2.2	934,000	1,128,654	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)	1.9	350,000	412,667	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)	1.9	954,000	1,128,028	2031/6/20
第129回利付国債 (20年)	1.8	280,000	328,269	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)	1.8	1,062,000	1,248,327	2031/9/20
第131回利付国債 (20年)	1.7	290,000	337,905	2031/9/20
第132回利付国債 (20年)	1.7	187,000	218,397	2031/12/20
第133回利付国債 (20年)	1.8	970,000	1,143,048	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)	1.8	1,265,000	1,494,255	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)	1.6	130,000	150,771	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)	1.7	952,000	1,116,819	2032/6/20
第138回利付国債 (20年)	1.5	230,000	264,780	2032/6/20
第139回利付国債 (20年)	1.6	10,000	11,621	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)	1.7	1,277,000	1,502,198	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)	1.7	220,000	259,340	2032/12/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第142回利付国債 (20年)	1.8	1,320,000	1,571,130	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)	1.6	1,060,000	1,239,701	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)	1.7	1,560,000	1,847,445	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)	1.7	1,230,000	1,459,505	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)	1.6	1,640,000	1,929,410	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)	1.5	840,000	979,893	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)	1.5	1,420,000	1,658,900	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)	1.4	1,510,000	1,746,843	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)	1.2	1,490,000	1,686,233	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)	1.2	1,180,000	1,336,338	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)	1.3	1,390,000	1,594,260	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)	1.2	1,110,000	1,258,751	2035/9/20
第155回利付国債 (20年)	1.0	1,320,000	1,460,527	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)	0.4	1,050,000	1,070,254	2036/3/20
第157回利付国債 (20年)	0.2	1,300,000	1,284,920	2036/6/20
第158回利付国債 (20年)	0.5	930,000	959,415	2036/9/20
第159回利付国債 (20年)	0.6	1,120,000	1,171,833	2036/12/20
第160回利付国債 (20年)	0.7	1,250,000	1,325,650	2037/3/20
第161回利付国債 (20年)	0.6	870,000	908,697	2037/6/20
第162回利付国債 (20年)	0.6	1,790,000	1,867,882	2037/9/20
第163回利付国債 (20年)	0.6	1,160,000	1,209,300	2037/12/20
第164回利付国債 (20年)	0.5	1,240,000	1,271,620	2038/3/20
第165回利付国債 (20年)	0.5	1,300,000	1,331,460	2038/6/20
第166回利付国債 (20年)	0.7	1,860,000	1,964,904	2038/9/20
第167回利付国債 (20年)	0.5	920,000	939,761	2038/12/20
第168回利付国債 (20年)	0.4	1,070,000	1,073,573	2039/3/20
第169回利付国債 (20年)	0.3	1,060,000	1,042,976	2039/6/20
第170回利付国債 (20年)	0.3	920,000	903,486	2039/9/20
第171回利付国債 (20年)	0.3	940,000	922,121	2039/12/20
第172回利付国債 (20年)	0.4	1,080,000	1,077,159	2040/3/20
第173回利付国債 (20年)	0.4	1,230,000	1,224,563	2040/6/20
第174回利付国債 (20年)	0.4	1,540,000	1,531,730	2040/9/20
第175回利付国債 (20年)	0.5	1,160,000	1,174,674	2040/12/20
第176回利付国債 (20年)	0.5	500,000	505,935	2041/3/20
小 計		242,655,000	259,888,132	
地方債証券				
第1回東京都公募公債 (20年)	1.54	20,000	20,644	2023/6/20
第4回東京都公募公債 (20年)	2.22	200,000	214,834	2024/9/20
第7回東京都公募公債 (30年)	2.51	10,000	13,446	2038/9/17
第20回東京都公募公債 (20年)	2.09	80,000	93,160	2029/9/20
第21回東京都公募公債 (20年)	2.19	80,000	94,152	2029/12/20
第22回東京都公募公債 (20年)	1.92	120,000	139,335	2030/6/20
第28回東京都公募公債 (20年)	1.59	100,000	115,751	2033/3/18
第33回東京都公募公債 (20年)	0.18	100,000	97,418	2036/6/20
第711回東京都公募公債	0.82	300,000	303,300	2022/9/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
第714回東京都公募公債	0.74	100,000	101,174	2022/12/20
第719回東京都公募公債	0.86	100,000	101,576	2023/3/20
第722回東京都公募公債	0.8	100,000	101,664	2023/6/20
第729回東京都公募公債	0.69	100,000	101,939	2024/3/19
平成24年度第9回北海道公募公債	0.79	100,000	101,132	2022/10/31
平成25年度第7回北海道公募公債	0.8	150,000	152,692	2023/8/30
平成29年度第15回北海道公募公債	0.23	117,000	118,155	2028/2/28
第29回1号宮城県公募公債	0.68	100,000	101,645	2023/10/25
第2回神奈川県公募公債(20年)	2.23	80,000	85,961	2024/9/20
第2回神奈川県公募公債(30年)	2.87	80,000	109,405	2036/6/20
第13回神奈川県公募公債(20年)	2.21	100,000	117,860	2029/12/20
第27回神奈川県公募公債(20年)	1.398	100,000	114,473	2034/9/20
第191回神奈川県公募公債	0.83	100,000	100,907	2022/6/20
第11回大阪府公募公債(20年)	1.693	100,000	117,316	2033/9/27
第359回大阪府公募公債	0.99	56,000	56,477	2022/3/29
第375回大阪府公募公債	0.835	100,000	101,873	2023/8/29
第376回大阪府公募公債	0.82	106,000	108,016	2023/9/27
第378回大阪府公募公債	0.7	100,000	101,732	2023/11/28
第385回大阪府公募公債	0.65	200,000	203,934	2024/6/27
第388回大阪府公募公債	0.54	200,000	203,504	2024/9/27
第393回大阪府公募公債	0.468	110,000	111,864	2025/2/26
第429回大阪府公募公債	0.197	103,000	103,787	2028/2/25
第464回大阪府公募公債	0.072	400,000	396,248	2031/1/28
平成26年度第2回京都府公募公債(15年)	1.071	200,000	215,248	2029/4/27
第1回兵庫県公募公債(15年)	1.66	300,000	325,035	2026/7/29
第2回兵庫県公募公債(30年)	2.36	40,000	53,508	2040/3/19
第4回兵庫県公募公債(15年)	1.31	100,000	108,098	2027/12/24
第5回兵庫県公募公債(15年)	1.31	100,000	108,562	2028/5/26
第10回兵庫県公募公債(20年)	2.24	100,000	118,224	2030/2/22
平成24年度第18回兵庫県公募公債	0.77	100,000	101,078	2022/10/19
第11回静岡県公募公債(20年)	1.841	350,000	405,265	2030/10/18
第14回静岡県公募公債(20年)	1.736	100,000	116,677	2032/6/18
平成25年度第1回静岡県公募公債	0.581	100,000	101,105	2023/4/19
平成25年度第5回静岡県公募公債	0.926	100,000	102,018	2023/7/25
平成25年度第8回静岡県公募公債	0.699	130,000	132,197	2023/10/24
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	2.28	300,000	352,770	2029/6/20
平成24年度第13回愛知県公募公債	0.772	100,000	101,184	2022/11/30
平成24年度第15回愛知県公募公債	0.744	250,000	252,985	2022/12/27
平成30年度第8回愛知県公募公債	0.255	200,000	202,540	2028/8/31
平成28年度第1回広島県公募公債(20年)	0.414	100,000	100,711	2036/9/26
第16回埼玉県公募公債(20年)	1.216	100,000	112,441	2035/8/14
平成26年度第8回埼玉県公募公債	0.335	100,000	101,205	2025/1/28
平成19年度第1回福岡県公募公債(30年)	2.62	70,000	94,439	2037/9/18
平成20年度第1回福岡県公募公債(30年)	2.28	80,000	104,493	2038/9/17
平成22年度第2回福岡県公募公債(20年)	2.116	400,000	476,048	2031/2/21

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
平成24年度第11回福岡県公募公債		0.8	100,000	101,419	2023/2/27
平成26年度第8回福岡県公募公債		0.441	100,000	101,560	2024/12/25
平成26年度第1回福岡県公募公債		0.654	100,000	102,010	2024/6/26
平成27年度第7回福岡県公募公債		0.464	100,000	102,074	2025/12/25
第9回千葉県公募公債(20年)		1.84	80,000	92,641	2030/10/11
平成24年度第6回千葉県公募公債		0.81	100,000	101,231	2022/11/25
平成25年度第1回千葉県公募公債		0.58	82,500	83,418	2023/4/25
平成25年度第8回千葉県公募公債		0.67	100,000	101,674	2023/11/24
第7回群馬県公募公債(20年)		0.313	100,000	99,396	2036/6/13
平成24年度第1回大分県公募公債		0.8	100,260	101,425	2022/10/31
平成27年度第1回大分県公募公債		0.476	203,400	207,588	2025/10/30
第114回共同発行市場公募地方債		0.82	400,000	404,420	2022/9/22
第117回共同発行市場公募地方債		0.72	100,000	101,145	2022/12/22
第123回共同発行市場公募地方債		0.87	500,000	509,090	2023/6/23
第124回共同発行市場公募地方債		0.91	400,000	407,928	2023/7/25
第127回共同発行市場公募地方債		0.68	100,000	101,645	2023/10/25
第130回共同発行市場公募地方債		0.76	100,000	102,029	2024/1/25
第131回共同発行市場公募地方債		0.66	100,000	101,810	2024/2/23
第142回共同発行市場公募地方債		0.345	200,000	202,478	2025/1/24
第145回共同発行市場公募地方債		0.406	100,000	101,553	2025/4/25
平成30年度第1回福島県公募公債		0.264	100,000	101,305	2028/11/30
平成25年度第1回栃木県公募公債		0.65	100,000	101,632	2023/11/29
平成24年度第2回熊本県公募公債		0.8	50,000	50,575	2022/10/26
平成24年度第1回浜松市公募公債		0.844	100,000	101,423	2023/1/25
平成25年度第1回浜松市公募公債		0.761	161,000	164,268	2024/1/24
第5回大阪市公募公債(20年)		2.47	100,000	117,494	2028/9/21
第15回大阪市公募公債(20年)		2.12	100,000	118,903	2031/1/24
平成23年度第10回大阪市公募公債		0.956	10,000	10,067	2022/1/27
第1回名古屋市公募公債(20年)		1.99	100,000	105,164	2023/12/20
第1回名古屋市公募公債(30年)		2.53	100,000	130,104	2035/3/20
第10回名古屋市公募公債(20年)		2.26	80,000	94,171	2029/8/17
第1回京都市公募公債(15年)		0.781	100,000	105,977	2030/12/20
第5回京都市公募公債(20年)		2.36	50,000	56,422	2026/12/18
平成24年度第4回京都市公募公債		0.801	100,000	101,142	2022/10/21
平成20年度第24回神戸市公募公債(20年)		2.08	200,000	230,166	2028/12/20
平成22年度第4回神戸市公募公債		1.895	100,000	116,182	2030/9/13
第7回横浜市公募公債(20年)		2.06	200,000	218,826	2025/12/19
第20回横浜市公募公債(20年)		2.1	80,000	93,312	2029/10/19
平成24年度第2回横浜市公募公債		0.815	100,000	101,153	2022/10/17
平成24年度第3回横浜市公募公債		0.729	100,000	101,160	2022/12/22
平成27年度第2回横浜市公募公債		0.568	200,000	204,520	2025/6/16
平成27年度第3回横浜市公募公債		0.524	400,000	408,680	2025/8/18
第27回横浜市公募公債(20年)		1.599	60,000	69,645	2033/5/20
第33回横浜市公募公債(20年)		0.323	100,000	99,614	2036/4/28
第35回横浜市公募公債(20年)		0.443	300,000	303,198	2036/10/28

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
平成22年度第8回札幌市公募公債(30年)	2.277	80,000	106,406	2040/9/20
平成23年度第3回札幌市公募公債	1.944	100,000	117,807	2031/7/29
平成24年度第10回札幌市公募公債	0.8	100,000	101,270	2022/12/20
第17回北九州市公募公債(20年)	1.529	100,000	115,941	2034/6/20
平成25年度第3回北九州市公募公債	0.728	100,000	101,857	2023/12/26
平成21年度第3回福岡市公募公債(20年)	2.14	100,000	116,854	2029/9/18
平成24年度第4回福岡市公募公債	0.8	200,000	202,324	2022/10/31
平成25年度第4回福岡市公募公債	0.68	50,000	50,821	2023/10/24
平成25年度第2回広島市公募公債	0.72	100,000	101,865	2023/12/27
平成26年度第4回福井県公募公債	0.425	100,000	101,627	2025/4/24
平成30年度第1回山梨県公募公債	0.289	100,000	101,514	2028/10/30
第4回京都市保証京都市土地開発公社債券	0.06	200,000	199,662	2023/3/29
第96回愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債	2.34	100,000	115,477	2028/12/20
小 計		14,919,160	15,856,280	
特殊債券(除く金融債)				
第70回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.2	100,000	116,038	2028/11/28
第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.3	100,000	132,989	2040/2/29
第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	100,000	116,773	2031/10/31
第162回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.737	100,000	116,617	2032/4/30
第165回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.83	100,000	126,050	2042/5/30
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.895	659,000	665,794	2022/6/30
第168回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.839	191,000	192,976	2022/7/29
第175回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.791	430,000	435,095	2022/10/31
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.834	301,000	305,403	2023/1/31
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.668	170,700	172,852	2023/3/17
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.541	153,000	154,667	2023/4/28
第195回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.911	323,000	329,495	2023/7/31
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.801	308,000	313,845	2023/9/29
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.601	124,000	126,356	2024/7/31
第226回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.39	100,000	114,534	2034/8/31
第231回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.495	183,000	186,149	2024/11/29
第39回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.801	100,000	101,027	2022/8/15
第41回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.791	252,000	254,915	2022/10/18
第43回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.734	400,000	404,784	2022/12/16
第44回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.834	101,000	102,451	2023/1/20
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.815	100,000	101,468	2023/2/17
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.668	17,000	17,214	2023/3/17
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.605	36,000	36,434	2023/5/16
第55回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.693	160,000	162,865	2023/12/18
第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.645	200,000	203,636	2024/3/15
第59回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.669	315,000	321,101	2024/4/12
第61回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.644	100,000	101,958	2024/6/14
第64回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.544	240,000	244,272	2024/9/13
第73回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.484	302,000	307,777	2025/6/13
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.381	150,000	152,479	2025/11/18

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.02	174,000	174,041	2026/3/13
第106回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.145	116,000	116,713	2028/3/14
第25回政府保証日本政策金融公庫債券	0.815	100,000	101,484	2023/2/24
第22回政府保証日本政策投資銀行	0.693	20,000	20,358	2023/12/18
第18回政府保証中部国際空港債券	0.668	200,000	202,540	2023/3/22
第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.35	100,000	112,042	2026/9/18
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.87	30,000	45,161	2046/12/20
第19回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.75	100,000	147,940	2047/3/20
第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.39	300,000	342,051	2027/7/20
第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.34	200,000	228,456	2027/10/20
第33回道路債券(財投機関債)	2.91	300,000	399,273	2034/6/20
第38回道路債券(財投機関債)	2.26	200,000	214,994	2024/9/20
第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.9	150,000	176,428	2032/3/19
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.038	200,000	203,814	2023/3/20
第145回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.523	100,000	118,596	2044/12/20
第150回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.133	100,000	110,421	2035/3/20
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.974	100,000	131,448	2055/3/19
第160回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.284	100,000	112,603	2035/9/20
第1回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.266	50,000	58,525	2029/6/28
第3回公営企業債券(20年)(財投機関債)	1.03	20,000	20,379	2023/3/22
第6回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.03	100,000	105,240	2023/12/20
第8回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.043	100,000	116,840	2030/6/28
第9回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.33	50,000	53,888	2024/9/24
第11回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.851	100,000	115,604	2030/10/28
第14回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.187	80,000	95,572	2031/4/28
第16回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.846	80,000	93,190	2031/8/28
第17回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.39	150,000	167,242	2026/3/24
第23回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.68	100,000	115,656	2032/7/28
F24回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.681	70,000	72,159	2023/3/17
第27回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.785	50,000	58,667	2033/1/28
第42回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.801	500,000	506,120	2022/11/28
第44回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.298	100,000	112,688	2035/6/28
F90回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.609	100,000	109,978	2028/1/28
F104回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.314	100,000	104,935	2025/3/7
F123回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.6	100,000	112,522	2030/3/19
F234回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.605	100,000	116,861	2035/4/27
第10回日本政策金融公庫(財投機関債)	2.167	80,000	93,976	2030/3/19
第15回日本政策金融公庫(財投機関債)	1.911	80,000	92,847	2030/10/29
第5回本州四国連絡橋債券(財投機関債)	2.23	200,000	215,702	2024/12/20
第48回福祉医療機構債券(財投機関債)	0.175	400,000	401,668	2026/12/18
第54回福祉医療機構債券(財投機関債)	0.225	100,000	100,739	2028/6/20
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	11,614	11,895	2042/5/10
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.08	11,973	12,292	2037/11/10
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	12,950	13,406	2042/6/10
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.27	12,220	12,585	2037/11/10

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.18	56,796	56,753	2032/5/10
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.16	60,888	60,882	2033/1/10
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	12,037	12,334	2042/8/10
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.08	73,289	73,083	2033/4/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	10,412	10,481	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.26	10,859	11,026	2037/5/10
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	11,982	12,260	2042/10/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.94	12,853	13,267	2038/11/10
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.25	10,896	11,060	2037/5/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.99	12,792	13,144	2042/12/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.19	11,519	11,775	2037/5/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.24	13,737	14,387	2039/5/10
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.15	11,922	12,249	2037/5/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.16	13,298	13,810	2043/5/10
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.64	11,129	11,235	2032/11/10
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.71	11,189	11,304	2032/11/10
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.8	10,569	10,677	2039/6/10
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.12	10,555	10,689	2039/7/10
第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.67	10,331	10,390	2040/5/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	12,317	12,609	2040/7/10
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.88	24,720	26,365	2045/2/10
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.87	24,749	26,319	2045/4/10
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	12,396	12,747	2040/12/10
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.61	26,566	28,053	2045/7/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	11,871	12,125	2041/2/10
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.36	26,471	27,669	2045/9/10
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	12,738	13,169	2041/4/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	11,635	11,941	2041/5/10
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6	30,861	32,715	2045/12/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.77	29,770	31,716	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	25,284	26,782	2046/2/10
第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.92	23,110	24,497	2046/4/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.76	25,053	26,465	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	26,418	27,881	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.21	11,799	12,166	2042/2/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	28,334	29,928	2046/8/10
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.51	31,093	32,797	2046/9/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.48	32,435	34,221	2046/10/10
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	36,086	38,058	2047/1/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	38,089	40,262	2047/4/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	39,325	41,415	2047/5/10
第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.21	40,818	42,762	2047/7/10
第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.11	40,767	42,535	2047/8/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	38,448	40,335	2048/3/10
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.32	43,702	46,095	2048/7/10

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.21	37,671	39,435	2048/9/10
第77回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.751	30,000	32,548	2026/6/19
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	39,146	40,772	2048/11/10
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	43,039	44,860	2049/2/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	89,548	93,124	2049/5/10
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.02	92,370	96,128	2049/6/10
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	49,692	51,562	2049/10/10
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	50,949	52,686	2049/11/10
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	53,506	54,976	2050/1/10
第95回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.81	65,750	67,859	2050/4/10
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.9	64,871	67,276	2050/7/10
第102回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.441	100,000	107,740	2027/3/19
第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.86	68,057	70,479	2050/12/10
第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	76,670	77,097	2051/6/10
第111回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.19	235,212	234,153	2051/8/10
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	405,740	410,746	2052/3/10
第121回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	2.227	130,000	171,499	2042/9/19
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.44	165,774	167,653	2052/7/10
第123回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.801	100,000	117,122	2032/9/17
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	83,565	84,381	2052/10/10
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	84,134	84,945	2053/1/10
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	85,629	86,670	2053/2/10
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	85,536	86,402	2053/3/10
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	86,396	87,282	2053/6/10
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	87,071	87,763	2053/7/10
第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.44	88,115	89,114	2053/9/10
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	88,538	89,727	2053/10/10
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	88,771	90,150	2053/11/10
第143回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.192	100,000	107,827	2028/10/20
第147回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.21	92,140	91,600	2054/8/10
第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.21	187,194	186,052	2054/11/10
第151回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.26	188,830	188,359	2054/12/10
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	97,616	98,204	2055/9/10
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	200,000	201,614	2056/5/10
第174回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.129	180,000	198,826	2035/11/20
第6回沖繩振興開発金融公庫債券(財投機関債)	2.04	50,000	54,109	2025/6/20
第7回国際協力機構債券(財投機関債)	1.991	70,000	82,392	2031/6/13
第33回中日本高速道路	1.084	50,000	50,187	2021/9/17
第78回中日本高速道路	0.06	300,000	300,180	2024/5/29
第29回西日本高速道路	0.31	200,000	202,370	2026/2/12
第72回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債)	0.905	100,000	106,191	2029/11/27
小 計		16,937,895	17,942,101	
金融債券				
い第806号商工債券	0.1	100,000	100,084	2022/7/27
い第814号商工債券	0.17	200,000	200,504	2023/3/27

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
金融債券	%	千円	千円	
い第832号商工債券	0.06	100,000	99,963	2024/9/27
い第848号商工債券	0.1	100,000	100,023	2026/1/27
い第818号農林債券	0.08	200,000	200,220	2023/7/27
第338回信金中金債	0.11	200,000	200,256	2023/1/27
第11号商工債券(10年)	0.66	300,000	305,919	2024/9/20
第236号商工債券(3年)	0.02	200,000	199,972	2022/9/27
第2回信金中金債(10年)	0.52	100,000	102,052	2025/9/26
小 計		1,500,000	1,508,993	
普通社債券				
第567回東京電力	1.958	100,000	109,374	2030/7/29
第499回中部電力	1.194	50,000	51,219	2023/6/23
第500回中部電力	0.875	300,000	307,446	2024/5/24
第508回関西電力	0.455	200,000	202,818	2027/4/23
第510回関西電力	0.49	200,000	203,176	2027/7/23
第518回関西電力	0.44	100,000	101,220	2028/6/20
第532回関西電力	0.18	100,000	100,302	2024/7/25
第381回中国電力	0.953	100,000	102,662	2024/4/25
第385回中国電力	0.728	100,000	102,582	2025/7/25
第409回中国電力	0.4	200,000	202,244	2028/9/25
第304回北陸電力	0.989	100,000	102,290	2023/10/25
第307回北陸電力	1.055	100,000	104,625	2026/6/25
第322回北陸電力	0.38	100,000	101,149	2027/6/25
第475回東北電力	0.809	300,000	307,398	2024/9/25
第509回東北電力	0.2	100,000	100,423	2024/5/24
第529回東北電力	0.07	300,000	299,334	2026/4/24
第427回九州電力	1.024	100,000	102,902	2024/5/24
第449回九州電力	0.43	300,000	304,323	2027/4/23
第484回九州電力	0.375	200,000	201,246	2029/11/22
第10回明治ホールディングス(サステナビリティ)	0.05	100,000	99,980	2026/4/23
第13回日本たばこ産業	0.355	200,000	200,786	2028/9/8
第6回ヒューリック	0.494	200,000	200,286	2028/10/20
第9回クラレ	0.34	100,000	100,240	2027/4/30
第42回王子ホールディングス	0.08	200,000	200,108	2026/3/24
第4回野村総合研究所	0.34	100,000	100,614	2028/3/23
第6回ヤフー	0.35	100,000	99,503	2024/12/6
第15回Zホールディングス	0.35	400,000	400,288	2023/6/9
第11回ブリヂストン	0.295	100,000	100,328	2027/4/21
第12回日本電気硝子	0.26	100,000	100,006	2028/2/25
第4回新日本製鐵	0.375	100,000	100,005	2027/5/20
第51回日本精工	0.19	100,000	99,145	2026/9/2
第19回日立製作所	0.16	100,000	99,396	2027/3/12
第17回パナソニック	0.47	100,000	101,301	2026/9/18
第18回デンソー	0.315	300,000	299,799	2028/3/17
第1回日本生命2017基金	0.304	100,000	100,027	2021/8/2
第9回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス	0.22	200,000	200,150	2025/10/10

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券	%	千円	千円	
第26回トヨタ自動車(サステナビリティ)	0.05	300,000	300,144	2026/3/18
第1回明治安田生命2018基金	0.315	100,000	100,152	2023/9/25
第1回明治安田生命2019基金	0.29	100,000	100,028	2024/8/2
第86回クレディセゾン	0.09	300,000	299,574	2026/4/15
第3回三菱UFJフィナンシャル・グループ	0.724	200,000	202,192	2025/3/5
第17回三菱UFJフィナンシャル・グループ	0.535	200,000	200,012	2028/5/31
第26回三菱東京UFJ銀行劣後特約付	1.95	100,000	106,834	2025/11/12
第29回三菱東京UFJ銀行劣後特約付	2.16	200,000	216,166	2026/1/20
第30回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	2.46	100,000	115,925	2031/1/20
第57回三菱東京UFJ銀行	2.22	100,000	103,136	2022/10/27
第28回芙蓉総合リース	0.14	300,000	299,721	2026/4/21
第4回みずほリース	0.24	100,000	100,249	2025/10/7
第16回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	0.18	100,000	100,444	2025/12/19
第17回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	0.28	100,000	100,725	2027/12/20
第31回東京センチュリー	0.01	300,000	299,679	2024/4/26
第32回東京センチュリー	0.09	300,000	299,571	2026/4/27
第64回ホンダファイナンス	0.001	300,000	299,649	2023/9/19
第65回ホンダファイナンス	0.16	100,000	100,139	2025/9/19
第95回トヨタファイナンス	0.001	300,000	300,096	2024/4/15
第96回トヨタファイナンス	0.06	500,000	500,120	2026/4/15
第31回リコーリース	0.3	100,000	100,619	2025/1/23
第35回リコーリース	0.04	100,000	99,959	2022/7/12
第39回リコーリース	0.05	300,000	299,769	2023/7/14
第40回リコーリース	0.04	200,000	199,818	2024/4/19
第41回リコーリース	0.14	300,000	299,574	2026/4/17
第7回イオンフィナンシャルサービス	0.19	100,000	99,898	2023/3/20
第79回アコム	0.29	200,000	199,686	2025/2/28
第80回アコム	0.28	100,000	99,676	2026/2/26
第47回日立キャピタル	0.874	100,000	101,489	2023/3/20
第70回日立キャピタル	0.2	200,000	200,416	2022/12/20
第87回日立キャピタル	0.06	300,000	299,913	2024/1/19
第201回オリックス	0.07	300,000	299,571	2026/4/21
第21回三井住友ファイナンス&リース	0.18	200,000	200,580	2023/11/27
第30回三井住友ファイナンス&リース	0.01	200,000	199,752	2023/8/10
第69回三菱UFJリース	0.24	300,000	301,242	2026/7/10
第27回野村ホールディングス	2.107	100,000	107,573	2025/9/24
第50回野村ホールディングス	0.22	100,000	100,055	2022/8/10
第12回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	0.61	100,000	101,856	2024/9/20
第12回森トラスト総合リート投資法人	0.1	100,000	99,514	2023/2/20
第36回京王電鉄	0.325	100,000	100,822	2027/9/17
第100回東日本旅客鉄道	1.981	100,000	125,848	2044/1/29
第163回東日本旅客鉄道	0.05	300,000	299,484	2026/4/15
第73回西日本旅客鉄道	0.05	200,000	199,654	2026/4/22
第11回東海旅客鉄道	1.15	100,000	101,824	2022/12/20
第17回東海旅客鉄道	2.21	200,000	214,550	2024/9/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券	%	千円	千円	
第50回阪急阪神ホールディングス	0.345	100,000	100,801	2028/9/13
第58回阪急阪神ホールディングス	0.09	100,000	99,911	2026/2/26
第64回名古屋鉄道	0.09	100,000	99,740	2026/3/23
第5回ソフトバンク	0.1	600,000	599,532	2023/7/28
第39回電源開発	0.929	100,000	102,408	2024/2/20
第57回電源開発	0.355	100,000	100,748	2028/7/20
第6回東京電力パワーグリッド	0.85	100,000	101,989	2027/8/31
第13回東京電力パワーグリッド	0.77	100,000	101,206	2028/4/19
第28回東京電力パワーグリッド	1.01	200,000	204,880	2029/7/10
第31回東京電力パワーグリッド	0.98	200,000	204,464	2029/10/9
第33回東京電力パワーグリッド	0.68	200,000	202,460	2027/1/27
第38回東京電力パワーグリッド	0.58	200,000	202,206	2025/7/16
第41回東京電力パワーグリッド	0.64	100,000	101,115	2026/10/8
第13回広島ガス	0.405	100,000	100,761	2028/9/13
第7回ファーストリテイリング	0.405	100,000	101,365	2028/6/6
第14回フランス相互信用連合銀行	0.563	200,000	200,314	2021/10/15
第19回フランス相互信用連合銀行	0.999	100,000	103,108	2025/10/15
第29回フランス相互信用連合銀行	0.25	100,000	99,886	2024/10/10
第8回新韓銀行	0.52	100,000	100,143	2022/11/2
第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.217	200,000	199,812	2023/1/25
第17回ナショナル・オーストラリア銀行	0.44	100,000	100,167	2024/1/23
小 計		17,350,000	17,533,409	
合 計		293,362,055	312,728,916	

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
国内 債券先物取引	10年国債標準物 百万円 757	百万円 -

○投資信託財産の構成

(2021年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 312,728,916	% 97.8
コール・ローン等、その他	7,146,774	2.2
投資信託財産総額	319,875,690	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年5月12日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	319,873,020,657	
コール・ローン等	2,210,594,182	
公社債(評価額)	312,728,916,071	
未収入金	4,330,705,000	
未収利息	576,666,066	
前払費用	25,209,338	
差入委託証拠金	930,000	
(B) 負債	5,701,129,489	
未払金	766,341,000	
未払解約金	4,934,787,787	
未払利息	702	
(C) 純資産総額(A-B)	314,171,891,168	
元本	233,376,402,849	
次期繰越損益金	80,795,488,319	
(D) 受益権総口数	233,376,402,849口	
1万口当たり基準価額(C/D)	13,462円	

<注記事項>

- ①期首元本額 466,348,174,986円
期中追加設定元本額 96,915,618,453円
期中一部解約元本額 329,887,390,590円
また、1口当たり純資産額は、期末1.3462円です。

②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

MUAM 日本債券インデックスファンド(適格機関投資家限定)	130,227,934,697円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	11,250,021,186円
eMAXIS Slim 国内債券インデックス	9,511,028,717円
eMAXIS 国内債券インデックス	8,920,095,654円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	7,880,689,781円
MUKAM 日本債券インデックスファンド2(適格機関投資家限定)	7,471,160,313円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	5,074,963,326円
三菱UFJ バランスファンドVA40型(適格機関投資家限定)	5,016,505,893円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド(安定成長型)	4,228,400,573円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション(適格機関投資家転売制限付)	4,195,222,287円
三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド	4,190,127,250円
つみたて8資産均等バランス	3,649,329,900円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	3,242,382,974円
国内債券セレクション(ラップ向け)	2,969,972,542円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	2,957,709,360円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2(適格機関投資家限定)	2,731,670,779円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド(成長型)	2,524,306,261円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド(安定型)	2,195,094,139円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド(積極型)	1,594,524,367円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	1,570,857,172円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	1,150,453,604円
つみたて4資産均等バランス	1,087,803,776円
三菱UFJ バランスファンドVA20型(適格機関投資家限定)	1,073,408,843円

○損益の状況 (2020年5月13日~2021年5月12日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	3,200,071,097	
受取利息	3,200,872,378	
支払利息	△ 801,281	
(B) 有価証券売買損益	△ 6,193,092,132	
売買益	351,754,219	
売買損	△ 6,544,846,351	
(C) 先物取引等取引損益	3,345,900	
取引益	12,693,100	
取引損	△ 9,347,200	
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 2,989,675,135	
(E) 前期繰越損益金	164,357,642,974	
(F) 追加信託差損益金	33,433,724,627	
(G) 解約差損益金	△114,006,204,147	
(H) 計(D+E+F+G)	80,795,488,319	
次期繰越損益金(H)	80,795,488,319	

(注) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) (G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

e MAX I S 最適化バランス (マイゴールキーパー)	1,010,323,103円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040 (確定拠出年金)	792,264,863円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	651,406,232円
e MAX I S バランス (4資産均等型)	649,786,652円
三菱UFJ バランスファンドVA 5 0型 (適格機関投資家限定)	537,708,078円
e MAX I S 最適化バランス (マイディフェンダー)	537,108,141円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	465,909,803円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	464,386,656円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01 (適格機関投資家限定)	464,145,255円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11 (適格機関投資家限定)	464,110,790円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	463,972,979円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金)	335,833,749円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	321,781,869円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	266,875,370円
e MAX I S 最適化バランス (マイフoward)	144,491,667円
三菱UFJ バランスVA 6 0 D (適格機関投資家限定)	133,386,984円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定成長型)	105,076,539円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	101,103,687円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型)	97,813,407円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	91,378,383円
三菱UFJ バランスVA 6 0 G (適格機関投資家限定)	78,943,615円
三菱UFJ バランスVA 3 0 D (適格機関投資家限定)	77,592,039円
e MAX I S バランス (波乗り型)	75,833,484円
三菱UFJ バランスファンド4 5 VA (適格機関投資家限定)	69,507,712円
e MAX I S 債券バランス (2資産均等型)	65,901,754円
三菱UFJ バランスVA 3 0 G (適格機関投資家限定)	52,399,445円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	31,304,318円
三菱UFJ バランスファンド5 5 VA (適格機関投資家限定)	20,824,787円
e MAX I S 最適化バランス (マイストライカー)	19,941,988円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	16,802,578円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	13,042,993円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	11,970,062円
国内債券インデックスファンド (ラップ向け)	8,568,340円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	8,528,748円
e MAX I S マイマネージャー 1970s	4,793,749円
コアバランス	2,317,696円
三菱UFJ バランスファンドVA 3 0型 (適格機関投資家限定)	2,212,911円
マルチアセット運用戦略ファンド (適格機関投資家限定)	1,805,991円
ラップ向けインデックスf 国内債券	743,627円
e MAX I S マイマネージャー 1980s	734,329円
e MAX I S マイマネージャー 1990s	105,082円
合計	233,376,402,849円

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

《第13期》決算日2022年1月26日

[計算期間：2021年1月27日～2022年1月26日]

「ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド」は、1月26日に第13期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第13期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。 対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し公社債の投資比率が100%を超える場合があります。 組入外貨建資産については、原則として対象インデックスとの連動を維持するため為替ヘッジを行います。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、為替ヘッジ比率を引き下げる、あるいは為替ヘッジ比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。
主要運用対象	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
9期(2018年1月26日)	12,633	1.0	382.76	1.0	98.5	—	183,523
10期(2019年1月28日)	12,706	0.6	385.22	0.6	98.0	—	226,657
11期(2020年1月27日)	13,512	6.3	409.73	6.4	97.8	—	237,847
12期(2021年1月26日)	14,060	4.1	427.41	4.3	98.7	—	250,742
13期(2022年1月26日)	13,500	△4.0	410.80	△3.9	97.2	—	280,521

(注) FTSE世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		FTSE世界国債インデックス (<small>除く日本、円ヘッジ円ベース</small>)		債 組 入 比 率 %	債 先 物 比 率 %
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2021年1月26日	円 14,060	% —	427.41	% —	98.7	—
1月末	14,050	△0.1	427.12	△0.1	99.1	—
2月末	13,632	△3.0	414.29	△3.1	100.7	—
3月末	13,606	△3.2	413.65	△3.2	101.0	—
4月末	13,592	△3.3	413.35	△3.3	98.6	—
5月末	13,622	△3.1	414.03	△3.1	99.3	—
6月末	13,671	△2.8	415.77	△2.7	98.1	—
7月末	13,912	△1.1	423.02	△1.0	97.8	—
8月末	13,914	△1.0	423.13	△1.0	98.6	—
9月末	13,694	△2.6	416.47	△2.6	99.5	—
10月末	13,686	△2.7	416.21	△2.6	100.8	—
11月末	13,771	△2.1	418.85	△2.0	97.1	—
12月末	13,646	△2.9	415.09	△2.9	100.5	—
(期 末) 2022年1月26日	13,500	△4.0	410.80	△3.9	97.2	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ4.0%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(−3.9%)を0.1%下回りました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

● 基準価額の主な変動要因

(下落要因)

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

● 投資環境について

◎ 債券市況

- ・ 先進国の債券市況は下落しました。
- ・ 先進国の債券市況は、期中中頃には新型コロナウイルス感染再拡大による景気の先行き懸念を背景とした金利低下等により、上昇する局面もありましたが、経済正常化期待や利上げ観測を背景とした金利上昇等により、期首との比較では下落しました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ 日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・ 期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。
- ・ 組入外貨建資産については、ベンチマークとの連動を維持するため、為替ヘッジを行いました。

● 当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは3.9%の下落になったため、乖離は $\Delta 0.1\%$ 程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ ありません。

(主なマイナス要因)

- ・ 評価時価差異要因[※]によるものです。

[※]ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる債券時価や為替レートが異なるため生じる要因です。

○ 今後の運用方針

- ・ ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
- ・ 組入外貨建資産については、原則としてベンチマークとの連動を維持するため、為替ヘッジを行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年1月27日～2022年1月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円	%	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(1)	(0.011)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	1	0.011	
期中の平均基準価額は、13,730円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○利害関係人との取引状況等

(2021年1月27日～2022年1月26日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	3,287,619	698,575	21.2	3,297,418	729,300	22.1
為替直物取引	66,133	54,221	82.0	46,398	21,623	46.6

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2022年1月26日現在)

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

区分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千アメリカドル 1,102,020	千アメリカドル 1,136,972	千円 129,432,980	% 46.1	% —	% 21.9	% 17.8	% 6.4
カナダ	千カナダドル 59,190	千カナダドル 61,383	5,533,080	2.0	—	1.0	0.6	0.4
メキシコ	千メキシコペソ 358,350	千メキシコペソ 363,641	2,008,063	0.7	—	0.4	0.2	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	126,540	148,585	19,115,479	6.8	—	4.6	2.2	—
イタリア	163,270	189,849	24,424,199	8.7	—	5.4	2.3	1.0
フランス	175,390	205,808	26,477,244	9.4	—	6.3	3.1	—
オランダ	34,640	40,586	5,221,464	1.9	—	1.3	0.3	0.2
スペイン	104,230	124,016	15,954,758	5.7	—	3.7	1.7	0.3
ベルギー	40,950	48,640	6,257,593	2.2	—	1.7	0.4	0.1
オーストリア	25,860	30,625	3,940,022	1.4	—	0.9	0.3	0.2
フィンランド	11,490	12,431	1,599,315	0.6	—	0.4	0.2	—
アイルランド	15,930	17,755	2,284,246	0.8	—	0.5	0.2	0.1
イギリス	千イギリスポンド 85,010	千イギリスポンド 105,622	16,246,861	5.8	—	4.6	1.1	0.1
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 57,150	千スウェーデンクローネ 62,193	764,975	0.3	—	0.1	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 54,050	千ノルウェークローネ 54,166	691,165	0.2	—	0.1	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 61,120	千デンマーククローネ 73,032	1,262,725	0.5	—	0.3	0.1	0.1
ポーランド	千ポーランドズロチ 50,900	千ポーランドズロチ 48,341	1,357,758	0.5	—	0.2	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 51,980	千オーストラリアドル 54,593	4,446,668	1.6	—	1.1	0.4	0.1
シンガポール	千シンガポールドル 13,090	千シンガポールドル 13,970	1,183,472	0.4	—	0.3	0.1	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 51,190	千マレーシアリンギット 52,375	1,422,668	0.5	—	0.3	0.1	0.1
中国	千中国元 99,000	千中国元 102,276	1,840,247	0.7	—	0.3	0.2	0.1
イスラエル	千イスラエルシェケル 29,910	千イスラエルシェケル 35,913	1,287,512	0.5	—	0.2	0.1	0.1
合 計	—	—	272,752,505	97.2	—	55.6	31.9	9.8

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	利 率	当 期 末			償還年月日
			額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	0.125 T-NOTE 230430	0.125	4,300	4,267	485,783	2023/4/30
	0.125 T-NOTE 230515	0.125	9,500	9,422	1,072,692	2023/5/15
	0.125 T-NOTE 230815	0.125	9,500	9,392	1,069,186	2023/8/15
	0.125 T-NOTE 240115	0.125	9,300	9,140	1,040,556	2024/1/15
	0.125 T-NOTE 240215	0.125	8,800	8,639	983,517	2024/2/15
	0.25 T-NOTE 231115	0.25	6,500	6,419	730,797	2023/11/15
	0.25 T-NOTE 240615	0.25	6,500	6,366	724,727	2024/6/15
	0.25 T-NOTE 250531	0.25	3,700	3,567	406,070	2025/5/31
	0.25 T-NOTE 250930	0.25	7,900	7,572	862,062	2025/9/30
	0.375 T-NOTE 240415	0.375	11,500	11,323	1,289,011	2024/4/15
	0.375 T-NOTE 240815	0.375	9,000	8,821	1,004,228	2024/8/15
	0.375 T-NOTE 240915	0.375	15,000	14,683	1,671,580	2024/9/15
	0.375 T-NOTE 251231	0.375	9,000	8,629	982,376	2025/12/31
	0.375 T-NOTE 260131	0.375	9,600	9,187	1,045,862	2026/1/31
	0.5 T-NOTE 270630	0.5	8,000	7,543	858,709	2027/6/30
	0.5 T-NOTE 270831	0.5	8,550	8,032	914,437	2027/8/31
	0.625 T-NOTE 241015	0.625	9,500	9,351	1,064,539	2024/10/15
	0.625 T-NOTE 260731	0.625	12,400	11,906	1,355,427	2026/7/31
	0.625 T-NOTE 270331	0.625	3,750	3,571	406,622	2027/3/31
	0.625 T-NOTE 271231	0.625	13,680	12,879	1,466,202	2027/12/31
	0.625 T-NOTE 300515	0.625	10,620	9,705	1,104,895	2030/5/15
	0.625 T-NOTE 300815	0.625	13,200	12,025	1,369,030	2030/8/15
	0.75 T-NOTE 241115	0.75	7,100	7,004	797,434	2024/11/15
	0.75 T-NOTE 260331	0.75	9,300	9,019	1,026,743	2026/3/31
	0.75 T-NOTE 260531	0.75	10,400	10,064	1,145,735	2026/5/31
	0.875 T-NOTE 260630	0.875	10,900	10,595	1,206,150	2026/6/30
	0.875 T-NOTE 301115	0.875	13,150	12,211	1,390,159	2030/11/15
	1 T-NOTE 241215	1.0	7,500	7,445	847,563	2024/12/15
	1.125 T-BOND 400515	1.125	8,150	6,861	781,160	2040/5/15
	1.125 T-NOTE 280831	1.125	10,000	9,628	1,096,110	2028/8/31
	1.125 T-NOTE 310215	1.125	13,490	12,779	1,454,837	2031/2/15
	1.25 T-BOND 500515	1.25	6,500	5,261	598,962	2050/5/15
	1.25 T-NOTE 280331	1.25	12,590	12,264	1,396,182	2028/3/31
	1.25 T-NOTE 280630	1.25	14,350	13,951	1,588,233	2028/6/30
	1.25 T-NOTE 310815	1.25	8,330	7,948	904,910	2031/8/15
	1.375 T-BOND 500815	1.375	10,240	8,554	973,832	2050/8/15
	1.375 T-NOTE 230630	1.375	4,100	4,133	470,518	2023/6/30
	1.375 T-NOTE 230831	1.375	7,700	7,761	883,587	2023/8/31
	1.375 T-NOTE 230930	1.375	7,000	7,056	803,261	2023/9/30
	1.375 T-NOTE 260831	1.375	3,400	3,375	384,274	2026/8/31
	1.375 T-NOTE 281031	1.375	2,240	2,189	249,303	2028/10/31
	1.375 T-NOTE 311115	1.375	1,310	1,261	143,648	2031/11/15
	1.5 T-NOTE 230331	1.5	5,100	5,147	585,958	2023/3/31
	1.5 T-NOTE 241031	1.5	6,000	6,045	688,189	2024/10/31
	1.5 T-NOTE 260815	1.5	8,800	8,783	999,913	2026/8/15
	1.5 T-NOTE 270131	1.5	8,000	7,972	907,553	2027/1/31

銘柄	当期末					償還年月日
	利率	額面金額	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ	%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
国債証券						
	1.5 T-NOTE 300215	1.5	7,800	7,665	872,620	2030/2/15
	1.625 T-NOTE 230430	1.625	7,850	7,933	903,173	2023/4/30
	1.625 T-NOTE 230531	1.625	4,900	4,957	564,331	2023/5/31
	1.625 T-NOTE 231031	1.625	6,700	6,780	771,844	2023/10/31
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	9,900	9,957	1,133,531	2026/2/15
	1.625 T-NOTE 260515	1.625	9,200	9,240	1,051,991	2026/5/15
	1.625 T-NOTE 260930	1.625	6,950	6,976	794,216	2026/9/30
	1.625 T-NOTE 261031	1.625	7,400	7,428	845,607	2026/10/31
	1.625 T-NOTE 261130	1.625	6,500	6,524	742,792	2026/11/30
	1.625 T-NOTE 290815	1.625	7,200	7,149	813,884	2029/8/15
	1.625 T-NOTE 310515	1.625	12,730	12,580	1,432,200	2031/5/15
	1.75 T-BOND 410815	1.75	1,300	1,208	137,574	2041/8/15
	1.75 T-NOTE 230515	1.75	10,000	10,126	1,152,807	2023/5/15
	1.75 T-NOTE 240630	1.75	9,850	9,995	1,137,837	2024/6/30
	1.75 T-NOTE 240731	1.75	6,800	6,902	785,784	2024/7/31
	1.75 T-NOTE 261231	1.75	6,800	6,863	781,369	2026/12/31
	1.875 T-BOND 410215	1.875	7,120	6,770	770,773	2041/2/15
	2 T-BOND 500215	2.0	5,950	5,777	657,715	2050/2/15
	2 T-BOND 510815	2.0	4,850	4,711	536,336	2051/8/15
	2 T-NOTE 240430	2.0	5,700	5,815	661,992	2024/4/30
	2 T-NOTE 240531	2.0	11,260	11,491	1,308,226	2024/5/31
	2 T-NOTE 250215	2.0	4,800	4,901	558,000	2025/2/15
	2 T-NOTE 250815	2.0	12,150	12,399	1,411,521	2025/8/15
	2 T-NOTE 261115	2.0	11,100	11,330	1,289,834	2026/11/15
	2.125 T-NOTE 231130	2.125	7,700	7,862	895,092	2023/11/30
	2.125 T-NOTE 240229	2.125	8,700	8,896	1,012,730	2024/2/29
	2.125 T-NOTE 241130	2.125	4,000	4,096	466,370	2024/11/30
	2.125 T-NOTE 250515	2.125	1,000	1,025	116,730	2025/5/15
	2.25 T-BOND 410515	2.25	3,350	3,383	385,147	2041/5/15
	2.25 T-BOND 460815	2.25	5,330	5,390	613,640	2046/8/15
	2.25 T-NOTE 231231	2.25	8,800	9,010	1,025,780	2023/12/31
	2.25 T-NOTE 240430	2.25	8,100	8,305	945,552	2024/4/30
	2.25 T-NOTE 241031	2.25	4,900	5,037	573,482	2024/10/31
	2.25 T-NOTE 241115	2.25	7,900	8,118	924,173	2024/11/15
	2.25 T-NOTE 241231	2.25	5,100	5,245	597,117	2024/12/31
	2.25 T-NOTE 251115	2.25	9,500	9,785	1,113,924	2025/11/15
	2.25 T-NOTE 260331	2.25	8,250	8,502	967,869	2026/3/31
	2.25 T-NOTE 270215	2.25	9,200	9,503	1,081,898	2027/2/15
	2.25 T-NOTE 270815	2.25	10,300	10,642	1,211,575	2027/8/15
	2.25 T-NOTE 271115	2.25	9,900	10,221	1,163,644	2027/11/15
	2.375 T-BOND 491115	2.375	5,430	5,705	649,541	2049/11/15
	2.375 T-BOND 510515	2.375	4,820	5,081	578,501	2051/5/15
	2.375 T-NOTE 240229	2.375	10,400	10,688	1,216,771	2024/2/29
	2.375 T-NOTE 240815	2.375	9,200	9,481	1,079,402	2024/8/15
	2.375 T-NOTE 270515	2.375	10,500	10,910	1,242,105	2027/5/15
	2.375 T-NOTE 290515	2.375	8,100	8,461	963,202	2029/5/15
	2.5 T-BOND 450215	2.5	4,180	4,405	501,576	2045/2/15

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘	柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券					
	2.5 T-BOND 460215	2.5	4,600	4,864	553,815	2046/2/15
	2.5 T-BOND 460515	2.5	4,780	5,058	575,826	2046/5/15
	2.5 T-NOTE 230815	2.5	9,050	9,280	1,056,531	2023/8/15
	2.5 T-NOTE 240515	2.5	10,200	10,523	1,198,044	2024/5/15
	2.5 T-NOTE 250131	2.5	10,000	10,363	1,179,755	2025/1/31
	2.625 T-NOTE 230630	2.625	5,600	5,744	653,914	2023/6/30
	2.625 T-NOTE 250331	2.625	4,500	4,682	533,011	2025/3/31
	2.625 T-NOTE 260131	2.625	5,400	5,643	642,399	2026/1/31
	2.625 T-NOTE 290215	2.625	8,800	9,327	1,061,821	2029/2/15
	2.75 T-BOND 420815	2.75	2,020	2,209	251,560	2042/8/15
	2.75 T-BOND 421115	2.75	4,200	4,592	522,765	2042/11/15
	2.75 T-BOND 470815	2.75	4,950	5,514	627,783	2047/8/15
	2.75 T-BOND 471115	2.75	4,700	5,240	596,578	2047/11/15
	2.75 T-NOTE 230531	2.75	3,000	3,079	350,551	2023/5/31
	2.75 T-NOTE 231115	2.75	8,800	9,082	1,033,998	2023/11/15
	2.75 T-NOTE 240215	2.75	6,800	7,038	801,236	2024/2/15
	2.75 T-NOTE 250630	2.75	7,900	8,262	940,578	2025/6/30
	2.75 T-NOTE 250831	2.75	7,500	7,852	893,888	2025/8/31
	2.75 T-NOTE 280215	2.75	13,650	14,496	1,650,307	2028/2/15
	2.875 T-BOND 430515	2.875	4,800	5,355	609,698	2043/5/15
	2.875 T-BOND 450815	2.875	4,300	4,840	551,083	2045/8/15
	2.875 T-BOND 461115	2.875	3,220	3,648	415,392	2046/11/15
	2.875 T-BOND 490515	2.875	6,300	7,263	826,899	2049/5/15
	2.875 T-NOTE 230930	2.875	6,000	6,196	705,398	2023/9/30
	2.875 T-NOTE 231031	2.875	8,500	8,787	1,000,335	2023/10/31
	2.875 T-NOTE 250430	2.875	4,900	5,141	585,314	2025/4/30
	2.875 T-NOTE 250731	2.875	10,500	11,038	1,256,580	2025/7/31
	2.875 T-NOTE 251130	2.875	5,400	5,686	647,345	2025/11/30
	2.875 T-NOTE 280515	2.875	12,100	12,955	1,474,855	2028/5/15
	2.875 T-NOTE 280815	2.875	10,850	11,634	1,324,423	2028/8/15
	3 T-BOND 420515	3.0	3,040	3,455	393,374	2042/5/15
	3 T-BOND 441115	3.0	4,250	4,860	553,293	2044/11/15
	3 T-BOND 450515	3.0	3,600	4,128	469,984	2045/5/15
	3 T-BOND 451115	3.0	2,910	3,351	381,483	2045/11/15
	3 T-BOND 470215	3.0	4,460	5,171	588,764	2047/2/15
	3 T-BOND 480215	3.0	5,430	6,349	722,850	2048/2/15
	3 T-BOND 480815	3.0	5,600	6,561	746,925	2048/8/15
	3 T-BOND 490215	3.0	6,180	7,275	828,188	2049/2/15
	3 T-NOTE 250930	3.0	7,500	7,927	902,493	2025/9/30
	3.125 T-BOND 411115	3.125	3,050	3,522	401,043	2041/11/15
	3.125 T-BOND 420215	3.125	3,350	3,877	441,458	2042/2/15
	3.125 T-BOND 430215	3.125	3,230	3,739	425,673	2043/2/15
	3.125 T-BOND 440815	3.125	4,690	5,467	622,463	2044/8/15
	3.125 T-BOND 480515	3.125	5,390	6,453	734,639	2048/5/15
	3.125 T-NOTE 281115	3.125	10,000	10,908	1,241,834	2028/11/15
	3.375 T-BOND 440515	3.375	4,150	5,018	571,352	2044/5/15
	3.375 T-BOND 481115	3.375	6,000	7,520	856,147	2048/11/15

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	当期末					償還年月日
	利率	額面金額	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	3.5 T-BOND 390215	3.5	1,700	2,057	234,229	2039/2/15
	3.625 T-BOND 430815	3.625	4,150	5,173	588,957	2043/8/15
	3.625 T-BOND 440215	3.625	4,200	5,256	598,444	2044/2/15
	3.75 T-BOND 410815	3.75	2,850	3,578	407,430	2041/8/15
	3.75 T-BOND 431115	3.75	2,510	3,190	363,200	2043/11/15
	3.875 T-BOND 400815	3.875	4,280	5,432	618,408	2040/8/15
	4.25 T-BOND 390515	4.25	2,100	2,777	316,236	2039/5/15
	4.25 T-BOND 401115	4.25	4,860	6,466	736,098	2040/11/15
	4.375 T-BOND 380215	4.375	1,390	1,850	210,715	2038/2/15
	4.375 T-BOND 391115	4.375	2,300	3,092	352,020	2039/11/15
	4.375 T-BOND 400515	4.375	2,450	3,305	376,351	2040/5/15
	4.375 T-BOND 410515	4.375	4,380	5,937	675,960	2041/5/15
	4.5 T-BOND 360215	4.5	950	1,264	144,005	2036/2/15
	4.5 T-BOND 380515	4.5	2,000	2,701	307,492	2038/5/15
	4.5 T-BOND 390815	4.5	2,420	3,298	375,488	2039/8/15
	4.625 T-BOND 400215	4.625	2,230	3,088	351,600	2040/2/15
	4.75 T-BOND 410215	4.75	2,960	4,187	476,728	2041/2/15
	5 T-BOND 370515	5.0	1,150	1,619	184,397	2037/5/15
	5.375 T-BOND 310215	5.375	3,120	4,079	464,371	2031/2/15
	6 T-BOND 260215	6.0	3,600	4,243	483,048	2026/2/15
	6.125 T-BOND 271115	6.125	6,300	7,868	895,705	2027/11/15
	6.25 T-BOND 230815	6.25	6,500	7,044	801,902	2023/8/15
	6.25 T-BOND 300515	6.25	2,550	3,444	392,166	2030/5/15
小計					129,432,980	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	0.75 CAN GOVT 241001	0.75	2,950	2,899	261,401	2024/10/1
	1 CAN GOVT 270601	1.0	1,500	1,451	130,825	2027/6/1
	1.25 CAN GOVT 250301	1.25	3,850	3,824	344,708	2025/3/1
	1.25 CAN GOVT 300601	1.25	7,320	7,049	635,440	2030/6/1
	1.5 CAN GOVT 230601	1.5	3,250	3,265	294,369	2023/6/1
	1.5 CAN GOVT 260601	1.5	3,650	3,636	327,765	2026/6/1
	1.5 CAN GOVT 310601	1.5	3,500	3,408	307,259	2031/6/1
	1.75 CAN GOVT 230301	1.75	4,000	4,029	363,224	2023/3/1
	2 CAN GOVT 230901	2.0	4,500	4,557	410,776	2023/9/1
	2 CAN GOVT 280601	2.0	1,500	1,530	137,922	2028/6/1
	2 CAN GOVT 511201	2.0	5,400	5,337	481,167	2051/12/1
	2.25 CAN GOVT 250601	2.25	4,200	4,302	387,843	2025/6/1
	2.25 CAN GOVT 290601	2.25	2,100	2,182	196,740	2029/6/1
	2.5 CAN GOVT 240601	2.5	3,200	3,285	296,130	2024/6/1
	2.75 CAN GOVT 481201	2.75	950	1,086	97,949	2048/12/1
	2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	1,010	1,186	106,926	2064/12/1
	3.5 CAN GOVT 451201	3.5	1,640	2,085	188,002	2045/12/1
	4 CAN GOVT 410601	4.0	790	1,034	93,210	2041/6/1
	5 CAN GOVT 370601	5.0	720	1,000	90,221	2037/6/1
	5.75 CAN GOVT 290601	5.75	1,450	1,855	167,276	2029/6/1
	5.75 CAN GOVT 330601	5.75	1,710	2,373	213,916	2033/6/1
小計					5,533,080	

銘柄			当期末				償還年月日	
			利率	額面金額	評価額			
					外貨建金額	邦貨換算金額		
メキシコ			%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円		
	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	10.0	44,750	47,751	263,689	2024/12/5	
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	9,000	10,743	59,328	2036/11/20	
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	46,350	43,590	240,709	2026/3/5	
		6.75 MEXICAN BONO 230309	6.75	20,000	19,980	110,333	2023/3/9	
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	35,750	35,792	197,649	2027/6/3	
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	28,000	28,225	155,865	2031/5/29	
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	10,800	10,829	59,802	2034/11/23	
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	24,100	23,366	129,032	2042/11/13	
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	41,500	42,012	231,998	2023/12/7	
		8 MEXICAN BONOS 240905	8.0	15,000	15,224	84,073	2024/9/5	
		8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	22,000	21,852	120,670	2047/11/7	
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	33,400	35,269	194,761	2029/5/31	
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	27,700	29,001	160,148	2038/11/18	
小	計					2,008,063		
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ			
	ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	4,700	4,797	617,139	2026/8/15
			0 BUND 290815	—	3,950	4,028	518,292	2029/8/15
			0 BUND 300815	—	6,000	6,104	785,363	2030/8/15
			0 BUND 310215	—	3,450	3,500	450,356	2031/2/15
			0 BUND 350515	—	4,240	4,224	543,502	2035/5/15
			0 BUND 500815	—	3,710	3,510	451,665	2050/8/15
			0 BUND 520815	—	880	821	105,748	2052/8/15
			0 OBL 240405	—	4,100	4,161	535,329	2024/4/5
			0 OBL 241018	—	7,500	7,629	981,524	2024/10/18
			0 OBL 261009	—	3,700	3,773	485,404	2026/10/9
			0.25 BUND 270215	0.25	3,500	3,616	465,246	2027/2/15
			0.25 BUND 280815	0.25	3,820	3,964	509,968	2028/8/15
			0.25 BUND 290215	0.25	4,600	4,778	614,734	2029/2/15
			0.5 BUND 250215	0.5	4,150	4,291	552,069	2025/2/15
			0.5 BUND 260215	0.5	6,130	6,375	820,182	2026/2/15
			0.5 BUND 270815	0.5	5,090	5,339	686,951	2027/8/15
			0.5 BUND 280215	0.5	3,600	3,786	487,167	2028/2/15
			1 BUND 240815	1.0	5,400	5,629	724,218	2024/8/15
			1 BUND 250815	1.0	4,850	5,116	658,268	2025/8/15
			1.25 BUND 480815	1.25	3,530	4,531	583,038	2048/8/15
			1.5 BUND 240515	1.5	4,850	5,095	655,487	2024/5/15
			1.75 BUND 240215	1.75	1,950	2,049	263,674	2024/2/15
			2.5 BUND 440704	2.5	3,110	4,812	619,169	2044/7/4
			2.5 BUND 460815	2.5	3,610	5,724	736,406	2046/8/15
			3.25 BUND 420704	3.25	2,310	3,831	492,887	2042/7/4
			4 BUND 370104	4.0	3,100	4,996	642,818	2037/1/4
			4.25 BUND 390704	4.25	2,150	3,759	483,684	2039/7/4
			4.75 BUND 280704	4.75	2,100	2,806	361,069	2028/7/4
			4.75 BUND 340704	4.75	3,580	5,785	744,282	2034/7/4
			4.75 BUND 400704	4.75	2,300	4,327	556,711	2040/7/4
			5.5 BUND 310104	5.5	3,810	5,805	746,924	2031/1/4
			5.625 BUND 280104	5.625	2,700	3,685	474,188	2028/1/4

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	6.25 BUND 300104	6.25	2,000	3,060	393,695	2030/1/4
		6.5 BUND 270704	6.5	2,070	2,862	368,302	2027/7/4
イタリア	国債証券	0 ITALY GOVT 240115	—	6,200	6,216	799,732	2024/1/15
		0.35 ITALY GOVT 250201	0.35	1,400	1,410	181,412	2025/2/1
		0.6 ITALY GOVT 310801	0.6	2,580	2,434	313,174	2031/8/1
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	3,400	3,452	444,187	2023/10/15
		0.95 ITALY GOVT 300801	0.95	3,900	3,851	495,533	2030/8/1
		1.45 ITALY GOVT 241115	1.45	2,600	2,700	347,355	2024/11/15
		1.45 ITALY GOVT 250515	1.45	3,300	3,439	442,487	2025/5/15
		1.45 ITALY GOVT 360301	1.45	2,000	1,971	253,672	2036/3/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	2,980	3,112	400,452	2025/6/1
		1.5 ITALY GOVT 450430	1.5	370	339	43,693	2045/4/30
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	6,000	6,314	812,401	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 301201	1.65	2,130	2,218	285,427	2030/12/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	3,190	3,304	425,155	2032/3/1
		1.85 ITALY GOVT 240515	1.85	4,400	4,594	591,082	2024/5/15
		1.85 ITALY GOVT 250701	1.85	4,300	4,542	584,362	2025/7/1
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	2,900	3,092	397,910	2025/12/1
		2 ITALY GOVT 280201	2.0	500	538	69,299	2028/2/1
		2.05 ITALY GOVT 270801	2.05	3,750	4,042	520,022	2027/8/1
		2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	3,300	3,584	461,094	2027/6/1
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	2,060	2,233	287,289	2036/9/1
		2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	2,400	2,668	343,279	2033/9/1
		2.45 ITALY GOVT 500901	2.45	2,850	3,064	394,298	2050/9/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	2,500	2,673	343,899	2024/12/1
		2.5 ITALY GOVT 251115	2.5	2,250	2,441	314,134	2025/11/15
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	3,120	3,551	456,919	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 281201	2.8	5,260	5,957	766,480	2028/12/1
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	1,620	1,763	226,887	2067/3/1
		2.95 ITALY GOVT 380901	2.95	2,770	3,269	420,593	2038/9/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	2,710	3,371	433,720	2046/9/1
		3.35 ITALY GOVT 350301	3.35	1,950	2,370	304,909	2035/3/1
		3.45 ITALY GOVT 480301	3.45	2,680	3,450	443,923	2048/3/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	6,150	7,357	946,525	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	3,400	3,730	479,968	2024/9/1
4 ITALY GOVT 370201	4.0	3,990	5,246	674,915	2037/2/1		
4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	5,100	5,417	696,952	2023/5/1		
4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	2,900	3,181	409,292	2024/3/1		
4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	4,300	4,631	595,840	2023/8/1		
4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	6,750	8,472	1,090,028	2028/9/1		
4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	2,470	3,755	483,089	2044/9/1		
5 ITALY GOVT 250301	5.0	3,850	4,431	570,110	2025/3/1		
5 ITALY GOVT 340801	5.0	1,750	2,459	316,422	2034/8/1		
5 ITALY GOVT 390801	5.0	3,620	5,395	694,170	2039/8/1		
5 ITALY GOVT 400901	5.0	3,680	5,559	715,262	2040/9/1		
5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	6,480	8,602	1,106,682	2029/11/1		
5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	2,600	3,782	486,660	2033/2/1		

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	6 ITALY GOVT 310501	6.0	5,240	7,492	963,955	2031/5/1
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	4,070	5,422	697,642	2027/11/1
		7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	3,000	3,967	510,454	2026/11/1
		9 ITALY GOVT 231101	9.0	2,550	2,964	381,432	2023/11/1
フランス	国債証券	0 O. A. T 240225	—	1,800	1,822	234,416	2024/2/25
		0 O. A. T 240325	—	5,000	5,063	651,441	2024/3/25
		0 O. A. T 250325	—	5,200	5,269	677,961	2025/3/25
		0 O. A. T 291125	—	300	298	38,383	2029/11/25
		0 O. A. T 311125	—	6,000	5,842	751,595	2031/11/25
		0.25 O. A. T 261125	0.25	5,250	5,374	691,435	2026/11/25
		0.5 O. A. T 250525	0.5	4,500	4,638	596,766	2025/5/25
		0.5 O. A. T 260525	0.5	7,150	7,395	951,412	2026/5/25
		0.5 O. A. T 290525	0.5	7,660	7,935	1,020,886	2029/5/25
		0.5 O. A. T 720525	0.5	1,350	1,042	134,093	2072/5/25
		0.75 O. A. T 280525	0.75	5,920	6,238	802,541	2028/5/25
		0.75 O. A. T 281125	0.75	5,670	5,978	769,133	2028/11/25
		0.75 O. A. T 520525	0.75	3,740	3,551	456,930	2052/5/25
		1 O. A. T 251125	1.0	6,000	6,312	812,066	2025/11/25
		1 O. A. T 270525	1.0	4,800	5,108	657,190	2027/5/25
		1.25 O. A. T 340525	1.25	4,670	5,125	659,409	2034/5/25
		1.25 O. A. T 360525	1.25	3,380	3,716	478,089	2036/5/25
		1.5 O. A. T 310525	1.5	8,960	10,039	1,291,609	2031/5/25
		1.5 O. A. T 500525	1.5	4,140	4,772	614,014	2050/5/25
		1.75 O. A. T 241125	1.75	7,200	7,662	985,821	2024/11/25
		1.75 O. A. T 390625	1.75	4,360	5,221	671,755	2039/6/25
		1.75 O. A. T 660525	1.75	1,600	1,999	257,294	2066/5/25
		2 O. A. T 480525	2.0	3,570	4,553	585,871	2048/5/25
		2.25 O. A. T 240525	2.25	12,600	13,435	1,728,511	2024/5/25
		2.5 O. A. T 300525	2.5	8,750	10,512	1,352,448	2030/5/25
		2.75 O. A. T 271025	2.75	6,780	7,935	1,020,912	2027/10/25
3.25 O. A. T 450525	3.25	3,370	5,154	663,164	2045/5/25		
3.5 O. A. T 260425	3.5	4,400	5,118	658,468	2026/4/25		
4 O. A. T 381025	4.0	3,520	5,468	703,538	2038/10/25		
4 O. A. T 550425	4.0	2,460	4,607	592,761	2055/4/25		
4 O. A. T 600425	4.0	1,900	3,730	479,874	2060/4/25		
4.5 O. A. T 410425	4.5	4,890	8,294	1,067,078	2041/4/25		
4.75 O. A. T 350425	4.75	3,760	5,863	754,358	2035/4/25		
5.5 O. A. T 290425	5.5	5,090	7,141	918,717	2029/4/25		
5.75 O. A. T 321025	5.75	4,650	7,367	947,780	2032/10/25		
6 O. A. T 251025	6.0	5,000	6,214	799,507	2025/10/25		
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 300715	—	4,250	4,264	548,661	2030/7/15
		0 NETH GOVT 380115	—	550	526	67,774	2038/1/15
		0 NETH GOVT 520115	—	1,120	1,007	129,636	2052/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	2,250	2,307	296,800	2025/7/15
		0.25 NETH GOVT 290715	0.25	1,240	1,274	163,921	2029/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	2,200	2,287	294,309	2026/7/15
		0.5 NETH GOVT 400115	0.5	1,270	1,331	171,301	2040/1/15

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オランダ	国債証券	0.75 NETH GOVT 270715	0.75	2,100	2,221	285,750	2027/7/15
		0.75 NETH GOVT 280715	0.75	2,500	2,658	342,047	2028/7/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	4,700	4,870	626,634	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	1,700	1,810	232,885	2024/7/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	1,930	2,437	313,539	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	2,290	3,677	473,163	2047/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	2,160	3,642	468,549	2042/1/15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	2,180	3,412	438,990	2037/1/15
		5.5 NETH GOVT 280115	5.5	1,800	2,424	311,937	2028/1/15
7.5 NETH GOVT 230115	7.5	400	431	55,561	2023/1/15		
スペイン	国債証券	0.35 SPAIN GOVT 230730	0.35	3,700	3,750	482,485	2023/7/30
		0.5 SPAIN GOVT 300430	0.5	3,150	3,173	408,284	2030/4/30
		0.5 SPAIN GOVT 311031	0.5	3,300	3,257	419,047	2031/10/31
		1 SPAIN GOVT 501031	1.0	1,040	934	120,253	2050/10/31
		1.2 SPAIN GOVT 401031	1.2	1,960	1,962	252,463	2040/10/31
		1.25 SPAIN GOVT 301031	1.25	3,970	4,230	544,222	2030/10/31
		1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3	3,500	3,728	479,685	2026/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 280430	1.4	3,800	4,090	526,293	2028/4/30
		1.4 SPAIN GOVT 280730	1.4	3,150	3,396	436,937	2028/7/30
		1.45 SPAIN GOVT 271031	1.45	4,050	4,362	561,221	2027/10/31
		1.45 SPAIN GOVT 290430	1.45	3,240	3,511	451,812	2029/4/30
		1.45 SPAIN GOVT 711031	1.45	70	61	7,855	2071/10/31
		1.5 SPAIN GOVT 270430	1.5	3,100	3,341	429,871	2027/4/30
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	2,900	3,077	395,971	2025/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	3,000	3,263	419,810	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	3,250	3,661	471,041	2030/7/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	3,550	3,864	497,184	2025/10/31
		2.35 SPAIN GOVT 330730	2.35	3,130	3,681	473,670	2033/7/30
		2.7 SPAIN GOVT 481031	2.7	2,140	2,783	358,080	2048/10/31
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	3,600	3,913	503,504	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	2,650	3,546	456,205	2046/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	2,090	3,133	403,124	2066/7/30
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	5,900	6,470	832,492	2024/4/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	2,790	4,067	523,232	2037/1/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	3,100	3,369	433,476	2023/10/31
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	3,650	4,284	551,192	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	2,500	4,070	523,661	2041/7/30
4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	3,600	3,987	512,968	2024/1/31		
4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	2,470	4,068	523,428	2040/7/30		
5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	2,800	3,726	479,461	2028/10/31		
5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	2,100	3,748	482,202	2044/10/31		
5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	4,310	6,558	843,797	2032/7/30		
5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	3,200	4,068	523,437	2026/7/30		
6 SPAIN GOVT 290131	6.0	3,470	4,868	626,377	2029/1/31		
ベルギー	国債証券	0.1 BEL GOVT 300622	0.1	1,770	1,771	227,932	2030/6/22
		0.4 BEL GOVT 400622	0.4	1,000	946	121,709	2040/6/22
		0.5 BEL GOVT 241022	0.5	1,800	1,852	238,377	2024/10/22

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ユーロ							
ベルギー	国債証券	0.8 BEL GOVT 250622	0.8	3,100	3,231	415,740	2025/6/22
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	3,200	3,378	434,645	2027/6/22
		0.8 BEL GOVT 280622	0.8	2,100	2,226	286,431	2028/6/22
		0.9 BEL GOVT 290622	0.9	2,300	2,457	316,208	2029/6/22
		1 BEL GOVT 260622	1.0	1,300	1,376	177,046	2026/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	2,900	3,121	401,617	2031/6/22
		1.25 BEL GOVT 330422	1.25	1,320	1,467	188,748	2033/4/22
		1.45 BEL GOVT 370622	1.45	550	621	79,985	2037/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	1,750	2,029	261,058	2047/6/22
		1.7 BEL GOVT 500622	1.7	450	534	68,729	2050/6/22
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	1,050	1,265	162,753	2038/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	890	1,230	158,265	2066/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	2,150	2,239	288,074	2023/6/22
		2.25 BEL GOVT 570622	2.25	1,150	1,572	202,349	2057/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	1,600	1,724	221,854	2024/6/22
		3 BEL GOVT 340622	3.0	990	1,304	167,775	2034/6/22
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	1,490	2,421	311,520	2045/6/22
		4 BEL GOVT 320328	4.0	1,160	1,606	206,666	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	2,010	3,289	423,149	2041/3/28
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	1,200	1,448	186,364	2026/3/28
5 BEL GOVT 350328	5.0	2,030	3,230	415,659	2035/3/28		
5.5 BEL GOVT 280328	5.5	1,690	2,292	294,929	2028/3/28		
オーストリア	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 230715	—	2,300	2,323	298,876	2023/7/15
		0 AUSTRIA GOVT 310220	—	750	739	95,135	2031/2/20
		0.25 AUSTRIA GOVT 361020	0.25	480	465	59,927	2036/10/20
		0.5 AUSTRIA GOVT 270420	0.5	1,240	1,288	165,707	2027/4/20
		0.5 AUSTRIA GOVT 290220	0.5	3,400	3,530	454,239	2029/2/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	1,350	1,416	182,248	2026/10/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 280220	0.75	1,450	1,528	196,680	2028/2/20
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	1,300	1,379	177,455	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	1,370	1,661	213,693	2047/2/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 861102	1.5	440	553	71,259	2086/11/2
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	1,500	1,592	204,845	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	1,900	1,980	254,768	2023/10/20
		2.1 AUSTRIA GOVT 170920	2.1	880	1,336	171,989	2117/9/20
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	1,100	1,385	178,221	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	1,070	1,672	215,156	2044/6/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	430	877	112,953	2062/1/26
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	2,100	3,281	422,123	2037/3/15
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	1,400	1,708	219,862	2026/3/15		
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	1,400	1,903	244,878	2027/7/15		
フィンランド	国債証券	0.125 FINNISH GOV 360415	0.125	500	480	61,806	2036/4/15
		0.125 FINNISH GOV 520415	0.125	390	343	44,215	2052/4/15
		0.25 FINNISH GOVT 400915	0.25	420	404	52,039	2040/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	700	726	93,461	2026/4/15
		0.5 FINNISH GOVT 270915	0.5	800	832	107,155	2027/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 280915	0.5	700	728	93,664	2028/9/15

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フィンランド	国債証券	0.5 FINNISH GOVT 290915	0.5	800	832	107,162	2029/9/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	1,010	1,070	137,754	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	900	943	121,383	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 340415	1.125	730	804	103,468	2034/4/15
		1.375 FINNISH GOV 470415	1.375	580	705	90,814	2047/4/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	2,050	2,173	279,602	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	570	815	104,891	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	590	701	90,291	2028/7/4
		4 FINNISH GOVT 250704	4.0	750	867	111,604	2025/7/4
アイルランド	国債証券	0.4 IRISH GOVT 350515	0.4	800	787	101,304	2035/5/15
		0.9 IRISH GOVT 280515	0.9	1,600	1,698	218,483	2028/5/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	1,600	1,688	217,288	2026/5/15
		1.1 IRISH GOVT 290515	1.1	1,170	1,259	161,997	2029/5/15
		1.3 IRISH GOVT 330515	1.3	1,100	1,208	155,478	2033/5/15
		1.35 IRISH GOVT 310318	1.35	1,000	1,107	142,459	2031/3/18
		1.5 IRISH GOVT 500515	1.5	820	939	120,864	2050/5/15
		1.7 IRISH GOVT 370515	1.7	1,230	1,430	184,016	2037/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	1,070	1,356	174,498	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	1,740	2,071	266,514	2030/5/15
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	2,200	2,313	297,633	2023/3/20
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	1,600	1,894	243,708	2025/3/13
		小 計					
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
国債証券	国債証券	0.125 GILT 240131	0.125	3,500	3,447	530,274	2024/1/31
		0.125 GILT 260130	0.125	1,650	1,599	246,019	2026/1/30
		0.25 GILT 310731	0.25	2,950	2,709	416,764	2031/7/31
		0.375 GILT 301022	0.375	1,900	1,784	274,480	2030/10/22
		0.625 GILT 250607	0.625	2,750	2,727	419,472	2025/6/7
		0.625 GILT 501022	0.625	1,030	868	133,657	2050/10/22
		0.875 GILT 291022	0.875	1,700	1,676	257,945	2029/10/22
		1 GILT 240422	1.0	3,400	3,410	524,661	2024/4/22
		1.25 GILT 270722	1.25	1,800	1,828	281,258	2027/7/22
		1.25 GILT 411022	1.25	2,640	2,593	399,001	2041/10/22
		1.5 GILT 260722	1.5	3,070	3,150	484,564	2026/7/22
		1.5 GILT 470722	1.5	1,850	1,920	295,349	2047/7/22
		1.5 GILT 530731	1.5	490	522	80,311	2053/7/31
		1.625 GILT 281022	1.625	900	936	144,080	2028/10/22
		1.625 GILT 711022	1.625	1,350	1,661	255,553	2071/10/22
		1.75 GILT 370907	1.75	2,400	2,545	391,594	2037/9/7
		1.75 GILT 490122	1.75	1,660	1,827	281,174	2049/1/22
		1.75 GILT 570722	1.75	2,630	3,042	468,040	2057/7/22
		2.25 GILT 230907	2.25	2,200	2,250	346,096	2023/9/7
		2.5 GILT 650722	2.5	2,100	3,105	477,662	2065/7/22
		2.75 GILT 240907	2.75	2,350	2,461	378,694	2024/9/7
		3.25 GILT 440122	3.25	2,760	3,758	578,083	2044/1/22
		3.5 GILT 450122	3.5	2,580	3,678	565,789	2045/1/22
3.5 GILT 680722	3.5	1,940	3,628	558,150	2068/7/22		

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘	柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
イギリス		%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円		
	国債証券	3.75 GILT 520722	3.75	1,830	2,963	455,792	2052/7/22
		4 GILT 600122	4.0	1,710	3,196	491,650	2060/1/22
		4.25 GILT 271207	4.25	2,860	3,389	521,320	2027/12/7
		4.25 GILT 320607	4.25	3,080	3,998	615,014	2032/6/7
		4.25 GILT 360307	4.25	2,350	3,256	500,866	2036/3/7
		4.25 GILT 390907	4.25	1,700	2,488	382,787	2039/9/7
		4.25 GILT 401207	4.25	1,820	2,707	416,479	2040/12/7
		4.25 GILT 461207	4.25	2,140	3,455	531,449	2046/12/7
		4.25 GILT 491207	4.25	1,710	2,884	443,751	2049/12/7
		4.25 GILT 551207	4.25	1,920	3,514	540,668	2055/12/7
		4.5 GILT 340907	4.5	2,700	3,722	572,664	2034/9/7
		4.5 GILT 421207	4.5	2,040	3,217	494,986	2042/12/7
		4.75 GILT 301207	4.75	1,950	2,551	392,489	2030/12/7
		4.75 GILT 381207	4.75	1,500	2,287	351,927	2038/12/7
		5 GILT 250307	5.0	2,930	3,295	506,982	2025/3/7
		6 GILT 281207	6.0	1,170	1,556	239,350	2028/12/7
小	計					16,246,861	
スウェーデン				千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ		
	国債証券	0.125 SWD GOVT 310512	0.125	7,300	7,187	88,408	2031/5/12
		0.75 SWD GOVT 280512	0.75	6,300	6,512	80,106	2028/5/12
		0.75 SWD GOVT 291112	0.75	7,700	7,999	98,398	2029/11/12
		1 SWD GOVT 261112	1.0	10,150	10,568	129,986	2026/11/12
		1.5 SWD GOVT 231113	1.5	11,800	12,151	149,468	2023/11/13
		2.5 SWD GOVT 250512	2.5	7,200	7,786	95,774	2025/5/12
		3.5 SWD GOVT 390330	3.5	6,700	9,986	122,832	2039/3/30
小	計					764,975	
ノルウェー				千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
	国債証券	1.25 NORWE GOVT 310917	1.25	3,800	3,603	45,978	2031/9/17
		1.375 NORWE GOVT 300819	1.375	4,900	4,727	60,321	2030/8/19
		1.5 NORWE GOVT 260219	1.5	2,850	2,828	36,097	2026/2/19
		1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	8,300	8,328	106,271	2025/3/13
		1.75 NORWE GOVT 270217	1.75	4,250	4,251	54,245	2027/2/17
		1.75 NORWE GOVT 290906	1.75	6,200	6,174	78,780	2029/9/6
		2 NORWE GOVT 230524	2.0	7,250	7,324	93,461	2023/5/24
		2 NORWE GOVT 280426	2.0	5,050	5,121	65,347	2028/4/26
		3 NORWE GOVT 240314	3.0	11,450	11,807	150,660	2024/3/14
小	計					691,165	
デンマーク				千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
	国債証券	0 DMK GOVT 311115	—	3,700	3,668	63,421	2031/11/15
		0.25 DMK GOVT 521115	0.25	5,250	5,153	89,106	2052/11/15
		0.5 DMK GOVT 271115	0.5	10,200	10,611	183,479	2027/11/15
		0.5 DMK GOVT 291115	0.5	10,700	11,173	193,183	2029/11/15
		1.5 DMK GOVT 231115	1.5	8,100	8,411	145,440	2023/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75	10,200	11,022	190,584	2025/11/15
		4.5 DMK GOVT 391115	4.5	12,970	22,990	397,507	2039/11/15
小	計					1,262,725	

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	当期末					
	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
ポーランド		%	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ	千円	
国債証券	0.75 POLAND 250425	0.75	6,000	5,510	154,761	2025/4/25
	1.25 POLAND 301025	1.25	4,700	3,812	107,094	2030/10/25
	2.25 POLAND 241025	2.25	4,000	3,895	109,414	2024/10/25
	2.5 POLAND 230125	2.5	4,800	4,778	134,209	2023/1/25
	2.5 POLAND 240425	2.5	3,000	2,957	83,055	2024/4/25
	2.5 POLAND 260725	2.5	5,000	4,756	133,580	2026/7/25
	2.5 POLAND 270725	2.5	5,600	5,218	146,582	2027/7/25
	2.75 POLAND 280425	2.75	3,700	3,483	97,846	2028/4/25
	2.75 POLAND 291025	2.75	5,000	4,633	130,126	2029/10/25
	3.25 POLAND 250725	3.25	3,550	3,516	98,770	2025/7/25
	4 POLAND 231025	4.0	4,150	4,210	118,267	2023/10/25
	5.75 POLAND 290425	5.75	1,400	1,568	44,047	2029/4/25
小計					1,357,758	
オーストラリア			千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
国債証券	0.25 AUST GOVT 241121	0.25	2,200	2,141	174,451	2024/11/21
	0.5 AUST GOVT 260921	0.5	3,700	3,513	286,157	2026/9/21
	1 AUST GOVT 301221	1.0	4,100	3,799	309,477	2030/12/21
	1.25 AUST GOVT 320521	1.25	1,660	1,553	126,508	2032/5/21
	1.5 AUST GOVT 310621	1.5	2,400	2,315	188,602	2031/6/21
	1.75 AUST GOVT 510621	1.75	1,750	1,459	118,839	2051/6/21
	2.25 AUST GOVT 280521	2.25	2,900	2,986	243,284	2028/5/21
	2.5 AUST GOVT 300521	2.5	3,520	3,692	300,741	2030/5/21
	2.75 AUST GOVT 291121	2.75	2,980	3,178	258,872	2029/11/21
	2.75 AUST GOVT 350621	2.75	1,500	1,612	131,308	2035/6/21
	2.75 AUST GOVT 410521	2.75	1,440	1,505	122,588	2041/5/21
	3 AUST GOVT 470321	3.0	1,680	1,819	148,168	2047/3/21
	3.25 AUST GOVT 250421	3.25	4,500	4,762	387,871	2025/4/21
	3.25 AUST GOVT 290421	3.25	3,100	3,403	277,212	2029/4/21
	3.25 AUST GOVT 390621	3.25	900	1,015	82,713	2039/6/21
	3.75 AUST GOVT 370421	3.75	1,600	1,914	155,960	2037/4/21
	4.25 AUST GOVT 260421	4.25	2,850	3,162	257,583	2026/4/21
	4.5 AUST GOVT 330421	4.5	3,800	4,771	388,676	2033/4/21
	4.75 AUST GOVT 270421	4.75	2,800	3,231	263,234	2027/4/21
	5.5 AUST GOVT 230421	5.5	2,600	2,755	224,414	2023/4/21
小計					4,446,668	
シンガポール			千シンガポールドル	千シンガポールドル		
国債証券	1.875 SINGAPORGOV 500301	1.875	250	237	20,086	2050/3/1
	2.25 SINGAPORGOVT 360801	2.25	1,550	1,602	135,712	2036/8/1
	2.375 SINGAPORGOV 250601	2.375	2,200	2,277	192,903	2025/6/1
	2.625 SINGAPORGOV 280501	2.625	1,000	1,057	89,555	2028/5/1
	2.75 SINGAPORGOVT 230701	2.75	1,400	1,438	121,865	2023/7/1
	2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	1,220	1,361	115,296	2042/4/1
	2.75 SINGAPORGOVT 460301	2.75	1,100	1,229	104,176	2046/3/1
	2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	950	1,024	86,807	2029/7/1
	2.875SINGAPORGOVT 300901	2.875	1,200	1,305	110,597	2030/9/1
	3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	500	523	44,303	2024/9/1
	3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	600	691	58,592	2033/9/1

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	当 期 末					
	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
シンガポール		%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円	
国債証券	3.5 SINGAPORGOV 270301	3.5	1,120	1,222	103,575	2027/3/1
小 計					1,183,472	
マレーシア			千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット		
国債証券	3.48 MALAYSIAGOV 230315	3.48	4,000	4,061	110,315	2023/3/15
	3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	7,500	7,544	204,921	2027/5/31
	3.757 MALAYSIAGOV 400522	3.757	1,000	935	25,403	2040/5/22
	3.8 MALAYSIAGOV 230817	3.8	4,000	4,088	111,045	2023/8/17
	3.828 MALAYSIAGOV 340705	3.828	4,000	3,921	106,519	2034/7/5
	3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	4,000	3,982	108,174	2033/4/15
	3.885 MALAYSIAGOV 290815	3.885	6,900	7,019	190,677	2029/8/15
	3.906 MALAYSIAGOV 260715	3.906	4,000	4,114	111,774	2026/7/15
	3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	3,000	3,096	84,115	2025/9/15
	4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	3,000	3,093	84,034	2024/7/15
	4.762 MALAYSIAGOV 370407	4.762	4,500	4,860	132,037	2037/4/7
	4.921 MALAYSIAGOV 480706	4.921	2,790	2,974	80,802	2048/7/6
	4.935 MALAYSIAGOV 430930	4.935	2,500	2,681	72,846	2043/9/30
小 計					1,422,668	
中国			千中国元	千中国元		
国債証券	2.85 CHINA GOVT 270604	2.85	7,000	7,118	128,084	2027/6/4
	2.88 CHINA GOVT 231105	2.88	9,000	9,119	164,087	2023/11/5
	3.01 CHINA GOVT 280513	3.01	6,000	6,137	110,437	2028/5/13
	3.02 CHINA GOVT 251022	3.02	7,000	7,163	128,897	2025/10/22
	3.02 CHINA GOVT 310527	3.02	5,000	5,113	92,015	2031/5/27
	3.13 CHINA GOVT 291121	3.13	4,000	4,111	73,973	2029/11/21
	3.25 CHINA GOVT 260606	3.25	8,000	8,280	148,992	2026/6/6
	3.27 CHINA GOVT 301119	3.27	6,000	6,255	112,558	2030/11/19
	3.29 CHINA GOVT 231018	3.29	11,000	11,219	201,872	2023/10/18
	3.39 CHINA GOVT 500316	3.39	4,000	4,030	72,524	2050/3/16
	3.54 CHINA GOVT 280816	3.54	4,000	4,235	76,211	2028/8/16
	3.57 CHINA GOVT 240622	3.57	11,000	11,369	204,567	2024/6/22
	3.61 CHINA GOVT 250607	3.61	9,000	9,402	169,175	2025/6/7
	3.81 CHINA GOVT 500914	3.81	4,000	4,342	78,139	2050/9/14
	3.86 CHINA GOVT 490722	3.86	4,000	4,374	78,710	2049/7/22
小 計					1,840,247	
イスラエル			千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル		
国債証券	1.5 ISRAEL FIXED 231130	1.5	4,000	4,101	147,041	2023/11/30
	1.75 ISRAEL FIXED 250831	1.75	3,800	3,971	142,366	2025/8/31
	2.25 ISRAEL FIXED 280928	2.25	5,300	5,764	206,648	2028/9/28
	4.25 ISRAEL FIXED 230331	4.25	4,500	4,875	174,795	2023/3/31
	5.5 ISRAEL FIXED 420131	5.5	6,310	9,594	343,967	2042/1/31
	6.25 ISRAEL FIXED 261030	6.25	6,000	7,606	272,692	2026/10/30
小 計					1,287,512	
合 計					272,752,505	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

○投資信託財産の構成

(2022年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 272,752,505	% 97.0
コール・ローン等、その他	8,292,236	3.0
投資信託財産総額	281,044,741	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(275,215,180千円)の投資信託財産総額(281,044,741千円)に対する比率は97.9%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 アメリカドル=113.84円	1 カナダドル=90.14円	1 メキシコペソ=5.5221円	1 ユーロ=128.65円
1 イギリスポンド=153.82円	1 スウェーデンクローネ=12.30円	1 ノルウェークローネ=12.76円	1 デンマーククローネ=17.29円
1 ポーランドズロチ=28.0868円	1 オーストラリアドル=81.45円	1 シンガポールドル=84.71円	1 マレーシアリングギット=27.163円
1 中国元=17.9929円	1 イスラエルシェケル=35.8499円		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	558,473,919,840
コール・ローン等	2,858,378,716
公社債(評価額)	272,752,505,508
未収入金	280,931,646,195
未収利息	1,833,988,051
前払費用	97,401,370
(B) 負債	277,952,224,639
未払金	277,841,008,349
未払解約金	111,215,366
未払利息	924
(C) 純資産総額(A-B)	280,521,695,201
元本	207,797,445,119
次期繰越損益金	72,724,250,082
(D) 受益権総口数	207,797,445,119口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,500円

<注記事項>

- ①期首元本額 178,336,920,306円
期中追加設定元本額 51,424,997,169円
期中一部解約元本額 21,964,472,356円
また、1口当たり純資産額は、期末13,500円です。

②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド(適格機関投資家転売制限付)	118,730,254,550円
MUKAM バランス・イノベーション(株式抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	11,198,560,066円
MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド2(適格機関投資家限定)	10,588,811,449円
三菱UFJ バランスファンド2 OVA(適格機関投資家限定)	10,350,412,727円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド(適格機関投資家限定)	9,621,727,405円
MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスオープン(適格機関投資家限定)	7,536,444,398円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	4,430,989,878円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	4,250,612,095円
MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	3,967,017,434円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	3,051,372,815円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	2,578,174,656円
MUKAM バランスファンド2020-04(適格機関投資家限定)	2,277,992,239円
MUKAM バランスファンド2019-12(適格機関投資家限定)	2,228,340,024円
MUKAM バランスファンド2020-07(適格機関投資家限定)	2,213,256,791円
MUKAM バランスファンド2020-10(適格機関投資家限定)	2,206,893,460円
MUKAM バランスファンド2021-03(適格機関投資家限定)	2,165,159,543円
MUKAM バランスファンド2021-06(適格機関投資家限定)	2,116,614,767円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション(適格機関投資家転売制限付)	1,360,826,023円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2(適格機関投資家限定)	1,299,676,485円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	1,175,239,308円
MUKAM バランス・イノベーション(債券重視型)(適格機関投資家転売制限付)	664,417,640円
MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制型)2(適格機関投資家転売制限付)	354,136,263円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01(適格機関投資家限定)	326,476,715円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11(適格機関投資家限定)	320,515,630円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05(適格機関投資家限定)	319,596,394円

○損益の状況 (2021年1月27日～2022年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	5,563,158,627
受取利息	5,564,232,651
支払利息	△ 1,074,024
(B) 有価証券売買損益	△16,126,892,634
売買益	34,483,235,386
売買損	△50,610,128,020
(C) 保管費用等	△ 28,829,538
(D) 当期損益金(A+B+C)	△10,592,563,545
(E) 前期繰越損益金	72,405,337,489
(F) 追加信託差損益金	19,090,240,529
(G) 解約差損益金	△ 8,178,764,391
(H) 計(D+E+F+G)	72,724,250,082
次期繰越損益金(H)	72,724,250,082

- (注) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(注) (F) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
(注) (G) 解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	318,320,078円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-07 (適格機関投資家限定)	314,518,867円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	314,267,273円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01 (適格機関投資家限定)	312,660,303円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	312,015,642円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11 (適格機関投資家限定)	311,484,137円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	311,241,135円
eMAXIS 先進国債券インデックス (為替ヘッジあり)	196,323,246円
eMAXIS 債券バランス (2資産均等型)	69,897,089円
マルチアセット運用戦略ファンド (適格機関投資家限定)	2,463,502円
ラップ向けインデックス f 先進国債券 (為替ヘッジあり)	735,092円
合計	207,797,445,119円

【お 知 ら せ】

「FTSE世界国債インデックス」について、2021年10月末より中国国債の組み入れに伴い、当該指数を参照等する当ファンドにおいて、新たに中国国債の組み入れを適宜開始します。